**投資信託説明書**
**（請求目論見書）**
**使用開始日：2025年6月13日**

# 三井住友・資産最適化ファンド

## （１安定重視型）／（２やや安定型）／（３バランス型）／

## （４やや成長型）／（５成長重視型）

### 追加型投信／内外／資産複合

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）、三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）、三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）、三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）および三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）の募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第５条の規定により有価証券届出書を2025年6月12日に関東財務局長に提出しており、2025年6月13日にその届出の効力が生じております。

| | |
|---|---|
| 発行者名 | 三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社 |
| 代表者の役職氏名 | 代表取締役社長　荻原　亘 |
| 本店の所在の場所 | 東京都港区虎ノ門一丁目１７番１号 |
| 有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所 | 該当事項はありません。 |

三井住友DSアセットマネジメント

本書は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。

１．本書は、金融商品取引法第13条第２項第２号に定める内容を記載した目論見書です。

２．運用による損益はすべて投資家の皆さまに帰属いたします。したがって、預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。

３．基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

４．投資信託は、預金保険、貯金保険または保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

５．税制に関する本書の記載内容は、税法の改正等により将来変更されることがあります。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）
以下、上記５ファンドを総称して「当ファンド」ということがあり、それぞれを「各ファンド」ということがあります。
また、「三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）」を「１安定重視型」、「三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）」を「２やや安定型」、「三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）」を「３バランス型」、「三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）」を「４やや成長型」、「三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）」を「５成長重視型」という略称でいうことがあります。

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。
＊ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。
当初元本は１口当たり１円です。委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド１兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。
ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。
※「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上１万口単位で表示される場合があります。）。
基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。
基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊紙面に、「１安定重視型」は「最適安定重視」、「２やや安定型」は「最適やや安定」、「３バランス型」は「最適バランス」、「４やや成長型」は「最適やや成長」、「５成長重視型」は「最適成長重視」として掲載されます。
委託会社に対する照会は下記においてできます。

| 照会先の名称 | コールセンター※ | ホームページ |
|---|---|---|
| 三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社 | 0120-88-2976 | https://www.smd-am.co.jp |

※お問い合わせは、午前９時～午後５時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

（5）【申込手数料】

ありません。

（6）【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

（7）【申込期間】

2025年6月13日から2025年12月11日まで
申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

（8）【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。
販売会社によっては一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
販売会社の詳細につきましては、前記「（４）発行（売出）価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

（9）【払込期日】

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。
各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

販売会社において払込みを取り扱います。（販売会社は前記「（４）発行（売出）価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。）

（１１）【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

イ　申込証拠金

ありません。

ロ　日本以外の地域における募集

ありません。

ハ　スイッチング

販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。

ニ　お申込不可日

上記にかかわらず、取得申込日が以下のいずれかに当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

・ニューヨークの取引所の休業日

・ニューヨークの銀行の休業日

ホ　クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の６）の適用

ありません。

ヘ　振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則に従って取り扱われるものとし、ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および当該振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

（参考：投資信託振替制度）

・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われます。

・受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます（原則として受益証券を保有することはできません。）。

・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。

・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

イ　当ファンドは、主として、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。

ロ　委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドにつき、金 2,000 億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ハ　当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

≪商品分類表≫

| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産<br>（収益の源泉） |
|---|---|---|
| 単位型 | 国内 | 株式 |
| 追加型 | 海外 | 債券 |
| | 内外 | 不動産投信 |
| | | その他資産<br>（　） |
| | | 資産複合 |

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

≪属性区分表≫

| 投資対象資産 | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態 | 為替ヘッジ |
|---|---|---|---|---|
| 株式<br>一般<br>大型株<br>中小型株 | 年1回 | グローバル<br>（日本を含む） | ファミリーファンド | あり<br>（部分ヘッジ） |
| | 年2回 | 日本 | | |
| | 年4回 | 北米 | | |
| 債券<br>一般<br>公債<br>社債<br>その他債券<br>クレジット属性<br>（　） | 年6回（隔月） | 欧州 | | |
| | 年 12 回（毎月） | アジア | | |
| | 日々 | オセアニア | | |
| | その他<br>（　） | 中南米 | | |
| 不動産投信 | | | ファンド・オブ・ファンズ | なし |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| その他資産<br>(投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信)資産配分変更型))<br><br>資産複合<br>(　　)<br>資産配分固定型<br>資産配分変更型 | | アフリカ<br><br>中近東(中東)<br><br>エマージング | | |

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。
※商品分類および属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。
※商品分類および属性区分の用語の定義については下記をご覧ください。なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でもご覧頂けます。

**一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」**

**≪商品分類表定義≫**

1．単位型投信・追加型投信の区分
（1）単位型投信…　当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
（2）追加型投信…　一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

2．投資対象地域による区分
（1）国内…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
（2）海外…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
（3）内外…　目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

3．投資対象資産（収益の源泉）による区分
（1）株式…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
（2）債券…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
（3）不動産投信（リート）…
目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

（4）その他資産…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記（1）から（3）に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

（5）資産複合…　目論見書または投資信託約款において、上記（1）から（4）に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

4．独立した区分

（1）MMF（マネー・マネージメント・ファンド）…

「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

（2）MRF（マネー・リザーブ・ファンド）…

「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

（3）ETF…　投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成 12 年政令 480 号）第 12 条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和 32 年法律第 26 号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

5.補足分類

（1）インデックス型…　目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

（2）特殊型…　目論見書または投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

**≪属性区分表定義≫**

1．投資対象資産による属性区分

（1）株式

①一般…　次の大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのものをいう。

②大型株…　目論見書または投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

③中小型株…　目論見書または投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

（2）債券

①一般…　次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのものをいう。

②公債…　目論見書または投資信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいう。

③社債…　目論見書または投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券…　目論見書または投資信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性…

目論見書または投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

（3）不動産投信…　これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

（4）その他資産…　組み入れている資産を記載するものとする。

（5）資産複合…　以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

①資産配分固定型…　目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

②資産配分変更型…　目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

2．決算頻度による属性区分

①年１回…　目論見書または投資信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいう。

②年２回…　目論見書または投資信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいう。

③年４回…　目論見書または投資信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいう。

④年６回（隔月）…　目論見書または投資信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいう。

⑤年 12 回（毎月）…　目論見書または投資信託約款において、年 12 回（毎月）決算する旨の記載があるものをいう。

⑥日々…　目論見書または投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

⑦その他…　上記属性にあてはまらないすべてのものをいう。

3．投資対象地域による属性区分（重複使用可能）

①グローバル…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

②日本…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

③北米…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

④欧州…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑤アジア…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑥オセアニア…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑦中南米…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑧アフリカ…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑨中近東（中東）…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑩エマージング…　目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

4．投資形態による属性区分

①ファミリーファンド…　目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。

②ファンド・オブ・ファンズ…　「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

5．為替ヘッジによる属性区分

①為替ヘッジあり…　目論見書または投資信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

②為替ヘッジなし…　目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

6．インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

①日経225

②ＴＯＰＩＸ

③その他の指数…上記指数にあてはまらないすべてのものをいう。

7．特殊型

①ブル・ベア型…　目論見書または投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含む。）を目指す旨の記載があるものをいう。

②条件付運用型…　目論見書または投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

③ロング・ショート型／絶対収益追求型…
目論見書または投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨もしくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

④その他型…　目論見書または投資信託約款において、上記①から③に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

（2）【ファンドの沿革】

| | |
|---|---|
| 2017年9月14日 | 信託契約締結、設定、運用開始 |
| 2023年12月13日 | 信託期間を2037年9月15日までから無期限に変更 |

（3）【ファンドの仕組み】

イ　当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社　「三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社」
証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

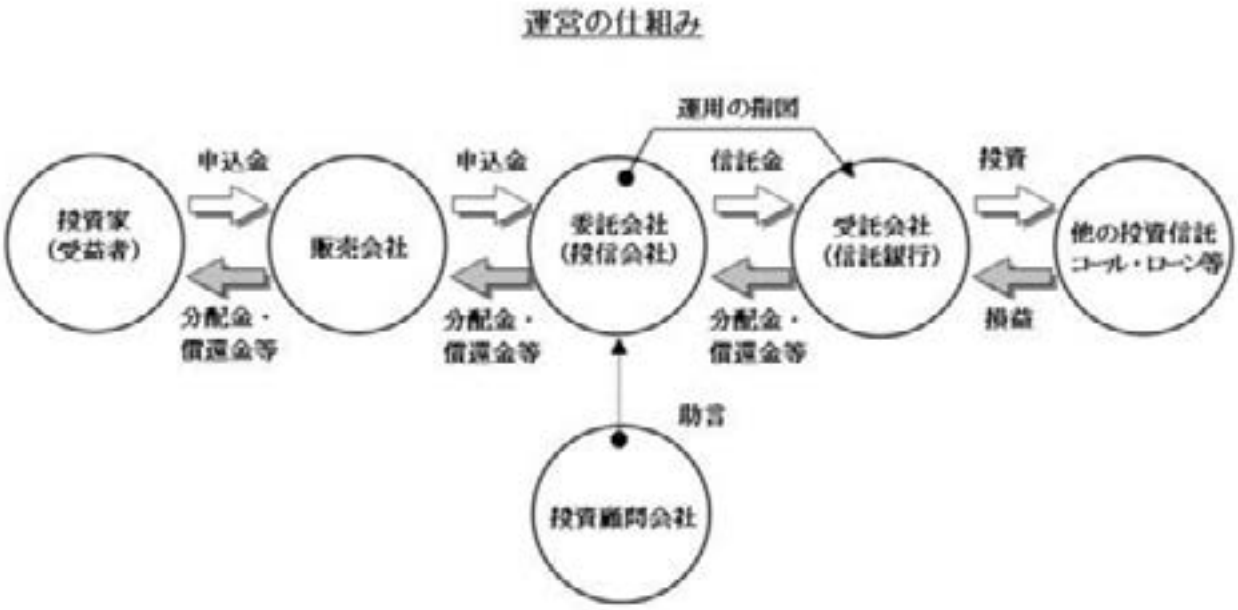
（ロ）受託会社　「三井住友信託銀行株式会社」
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

（ハ）販売会社
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

〔参考情報：投資顧問会社〕

以下の法人は当ファンドの関係法人には該当しませんが、当ファンドの運用に関し助言等を行う投資顧問会社であり、間接的に当ファンドの運用に関与します。

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社
各ファンドの基本資産配分に関する投資助言等を行います。




ロ　委託会社の概況

（イ）資本金の額

20億円（2025年3月31日現在）

（ロ）会社の沿革

| | |
|---|---|
| 1985年7月15日 | 三生投資顧問株式会社設立 |
| 1987年2月20日 | 証券投資顧問業の登録 |
| 1987年6月10日 | 投資一任契約にかかる業務の認可 |
| 1999年1月1日 | 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合 |
| 1999年2月5日 | 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更 |
| 2000年1月27日 | 証券投資信託委託業の認可取得 |
| 2002年12月1日 | 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更 |
| 2013年4月1日 | トヨタアセットマネジメント株式会社と合併 |
| 2019年4月1日 | 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社に商号変更 |

（ハ）大株主の状況

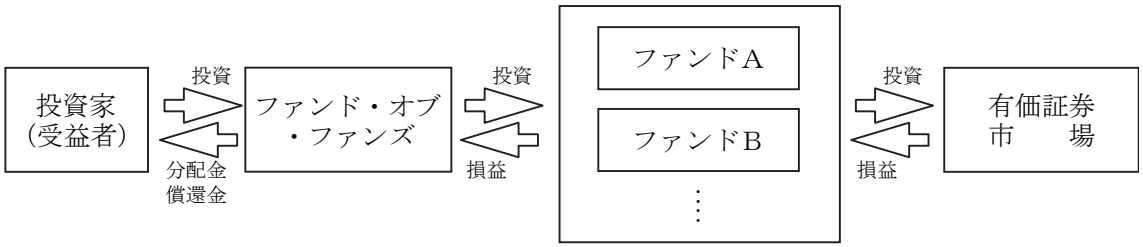
(2025年3月31日現在)

| 名称 | 住所 | 所有株式数(株) | 比率(%) |
|---|---|---|---|
| 株式会社三井住友フィナンシャルグループ | 東京都千代田区丸の内一丁目１番２号 | 16,977,897 | 50.1 |
| 株式会社大和証券グループ本社 | 東京都千代田区丸の内一丁目９番１号 | 7,946,406 | 23.5 |
| 三井住友海上火災保険株式会社 | 東京都千代田区神田駿河台三丁目９番地 | 5,080,509 | 15.0 |
| 住友生命保険相互会社 | 大阪府大阪市中央区城見一丁目４番35号 | 3,528,000 | 10.4 |
| 三井住友信託銀行株式会社 | 東京都千代田区丸の内一丁目４番１号 | 337,248 | 1.0 |

ハ　ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

一般に、「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、複数の他の投資信託（ファンド）を組み入れることにより運用を行います（投資信託に投資する投資信託）。また、種々の特長を持った投資信託を購入することにより、効率的に資産配分を行います。

**〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕**



## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

イ　基本方針

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。

ロ　投資態度

（イ）主として、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に各ファンド以下の運用を行います。

（１安定重視型）安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。

（２やや安定型）安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。

（３バランス型）信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。

（４やや成長型）信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。

（５成長重視型）信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

（ⅰ）主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券に投資します。

（ⅱ）投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

（ロ）イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

（ⅰ）基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

（ハ）実質組入外貨建資産については、投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

（ニ）投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

（ホ）資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ファンドの特色

### 1 投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資します。

□ インデックスファンドや上場投資信託証券（ETF）への投資を通じて、以下の資産等に投資します。

| | |
|---|---|
| 債券 | ■ 国内債券 ■ 先進国債券（除く日本） ■ 先進国債券（除く日本）（為替ヘッジあり） ■ 新興国債券 |
| 株式 | ■ 国内株式 ■ 先進国株式（除く日本） ■ 新興国株式 |
| リート | ■ 国内リート ■ 外国リート |

### 2 イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

□ イボットソン・アソシエイツ・ジャパンは、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して基本資産配分比率を算出し、助言します。

### 3 目標リスク水準の異なる5つのファンドからお選びいただけます。

目標リスク水準とは
目標リスク水準は各ファンドのリスク（標準偏差）の目安を表示したものです。
一般にリスクの数値が大きいほどリターン（収益）の振れ幅が大きくなる傾向があります。

| | |
|---|---|
| 1安定重視型 | 安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。 |
| 2やや安定型 | 安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。 |
| 3バランス型 | 信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。 |
| 4やや成長型 | 信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。 |
| 5成長重視型 | 信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。 |

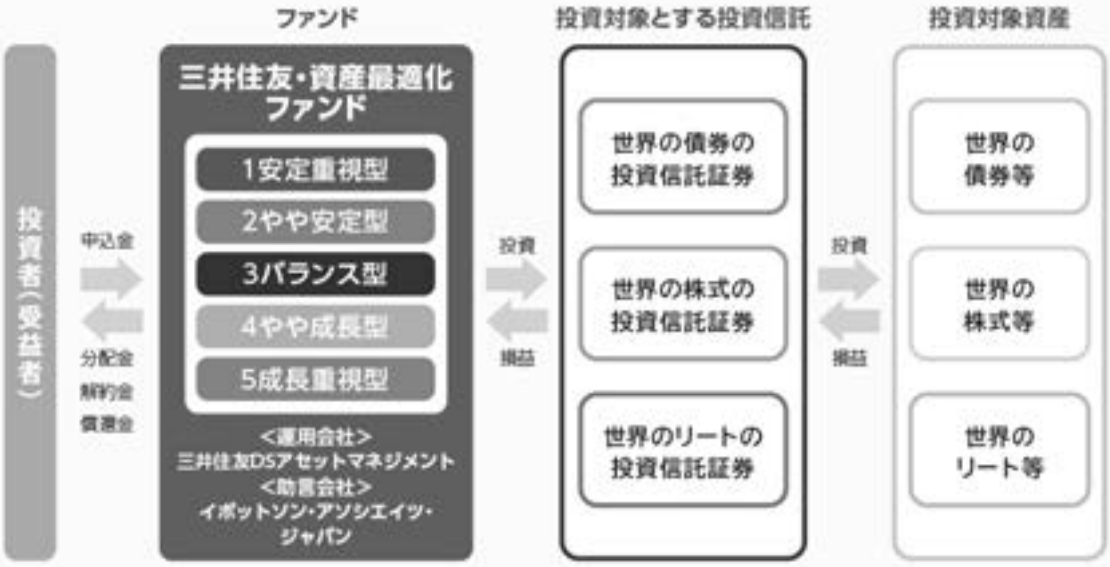
□ 各ファンド間でスイッチングが可能です。ただし、販売会社によっては、スイッチングを行わない場合があります。また、一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。

**4** 実質組入外貨建資産については、投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジは行いません。

※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ファンドのしくみ

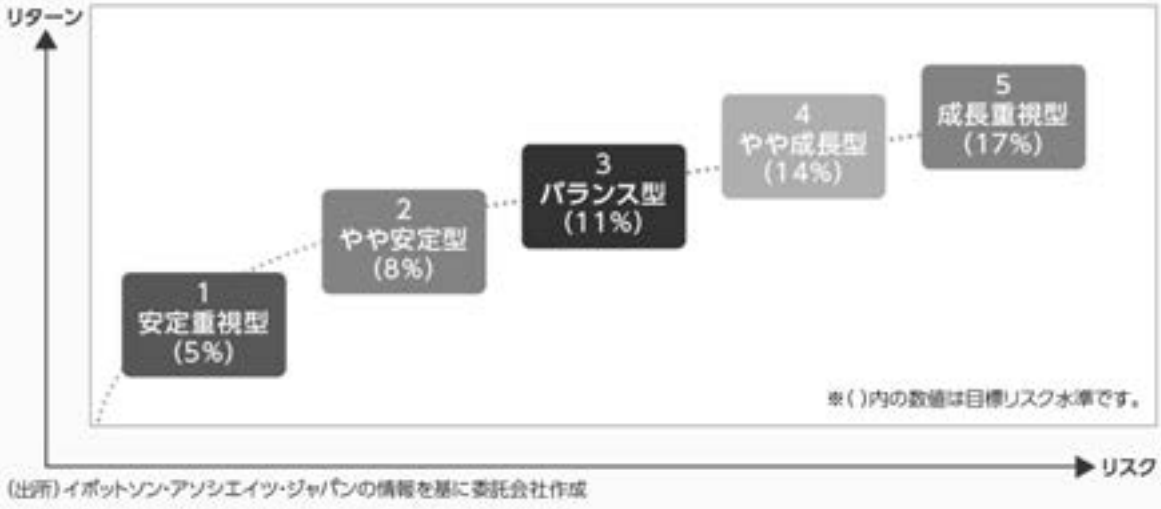
□ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



## ライフプランに合わせて5つのファンドから選択

■投資者の皆さまそれぞれのライフプランやリスク許容度に合わせて、目標リスク水準が異なる5つのファンドからお選びいただけます。

［ 5つのファンドの目標リスク水準とリスク・リターン特性のイメージ ］

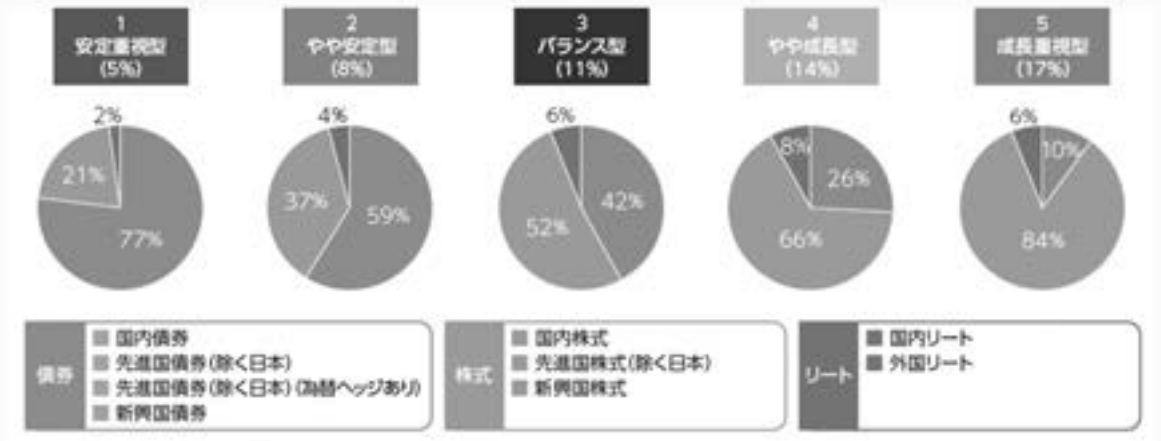



(出所)イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの情報を基に委託会社作成

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。
※目標リスク水準は2025年3月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

## ポートフォリオの基本資産配分イメージ

■目標リスク水準に応じて、基本資産配分比率は各ファンドで異なります。

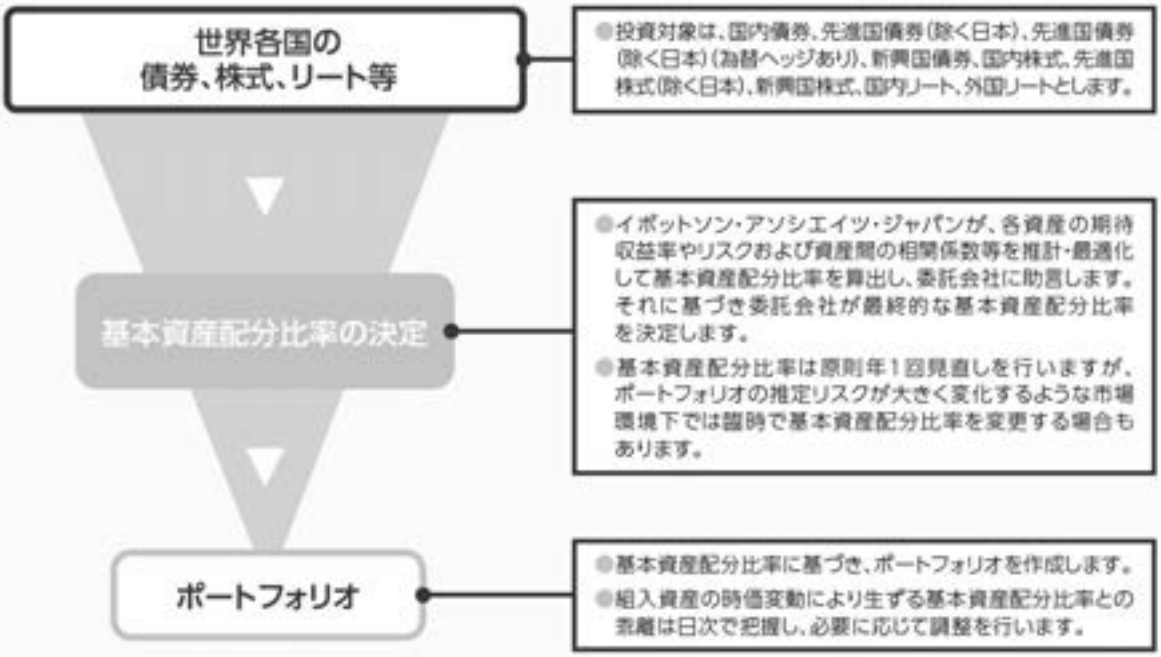



※( )内の数値は目標リスク水準です。
※円グラフ内の数値は基本資産配分比率です。
(出所)イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの情報を基に委託会社作成

※基本資産配分比率は2025年3月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

## 運用プロセス

■世界各国の債券、株式およびリート等を投資対象とします。
■イボットソン・アソシエイツ・ジャパンからの投資助言に基づき、委託会社の運用部 マルチアセットグループが基本資産配分比率を決定し、ポートフォリオを構築します。




※上記の運用プロセスは2025年3月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

※運用担当部署の概要については、委託会社のホームページをご覧ください。
<運用担当者に係る事項>https://www.smd-am.co.jp/corporate/investment/pdf/org_structure01.pdf

## イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社について

ibbotson
a Morningstar company

■イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、米国のモーニングスター・グループの日本法人です。
■1977年にロジャー・G・イボットソン(現イェール大学経営大学院教授)が金融経済学の研究成果を投資実務に役立たせるという理念に基づき、米国Ibbotson Associates, Inc.(現Morningstar Investment Management LLC)を設立しました。
■イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、世界の資本市場の長期的なリスクとリターンの調査研究に基づき、中立的な観点から投資判断に役立つ情報とポートフォリオ構築ツールを提供しています。

(出所)イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの情報を基に委託会社作成

(2)【投資対象】

イ　投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

（イ）次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

１．有価証券

２．約束手形

３．金銭債権

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

１．為替手形

ロ　投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、投資信託証券または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

２．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の性質を有するもの

３．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

なお、第３号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

ハ　投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記ロに掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

１．預金

２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

以下は、2025年3月末現在で知り得る情報に基づくものであり、今後、変更される場合があります。

● すべての投資信託に投資するとは限りません。また、投資対象とする投資信託は、今後、追加・入替等が行われることがあります。

▶債券

**国内債券**

| | |
|---|---|
| ファンド名 | 国内債券パッシブ・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | ●NOMURA-BPI(総合)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。<br>●日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.03% |

**先進国債券（除く日本）…為替ヘッジなし**

| | |
|---|---|
| ファンド名 | 外国債券パッシブ・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | ●FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。<br>●ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。<br>●保有する外貨建て資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1% |

## 為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）…為替ヘッジあり

| | |
|---|---|
| ファンド名 | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | ●FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ換算ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。<br>●ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。<br>●保有する外貨建て資産については、対円での為替のフルヘッジを原則とします。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1% |

## 新興国債券…為替ヘッジなし*1

| | |
|---|---|
| ファンド名 | iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF |
| 形態 | 米国籍外国投資信託（米ドル建て） |
| 運用会社 | ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ |
| 運用の基本方針 | ●J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。<br>●ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。 |
| 管理費用*2 | 年0.39% |
| 購入の可否*3 | 日本において一般投資者の購入が可能です。 |

*1 新興国債券への基本資産配分比率は10%を上限とします。

*2 管理費用とはETFの運用管理費用およびその他費用をETFの平均純資産総額で除したもので、本書の数値はETFの直近の目論見書等で開示されているものです。

*3 外国籍のETFは、海外の上場有価証券を取り次ぐことのできる証券会社を通じて、日本国内の一般の投資者が、直接、購入することができるものがあります。
直接購入される際は、売買委託手数料（証券会社ごとに異なります。）がかかります。また、円貨と外貨を交換する際に、証券会社が別途定める手数料がかかります。

▶株式

**国内株式**

| | |
|---|---|
| ファンド名 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | 主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08% |

**先進国株式(除く日本)…為替ヘッジなし**

| | |
|---|---|
| ファンド名 | 外国株式インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | ●主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。<br>●外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

**新興国株式…為替ヘッジなし**

| | |
|---|---|
| ファンド名 | エマージング株式インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | ●主として新興国の株式(預託証書(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。<br>●外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

▶リート

**国内リート**

| | |
|---|---|
| ファンド名 | Jリート・インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | ●東証REIT指数(配当込み)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。<br>●日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(REIT)を主要投資対象とします。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

**外国リート…為替ヘッジなし**

| | |
|---|---|
| ファンド名 | 外国リート・インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | ●S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。<br>●日本を除く世界各国の不動産投資信託(REIT)などを主要投資対象とします。<br>●外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

指数の著作権など

●NOMURA-BPIは野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社、FTSE世界国債インデックスはFTSE Fixed Income LLC、J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックスはJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー、TOPIX(東証株価指数)および東証REIT指数は株式会社JPX総研、MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスはMSCI Inc.、S&P先進国REIT指数はS&P Dow Jones Indices LLCが、それぞれ公表している指数です。

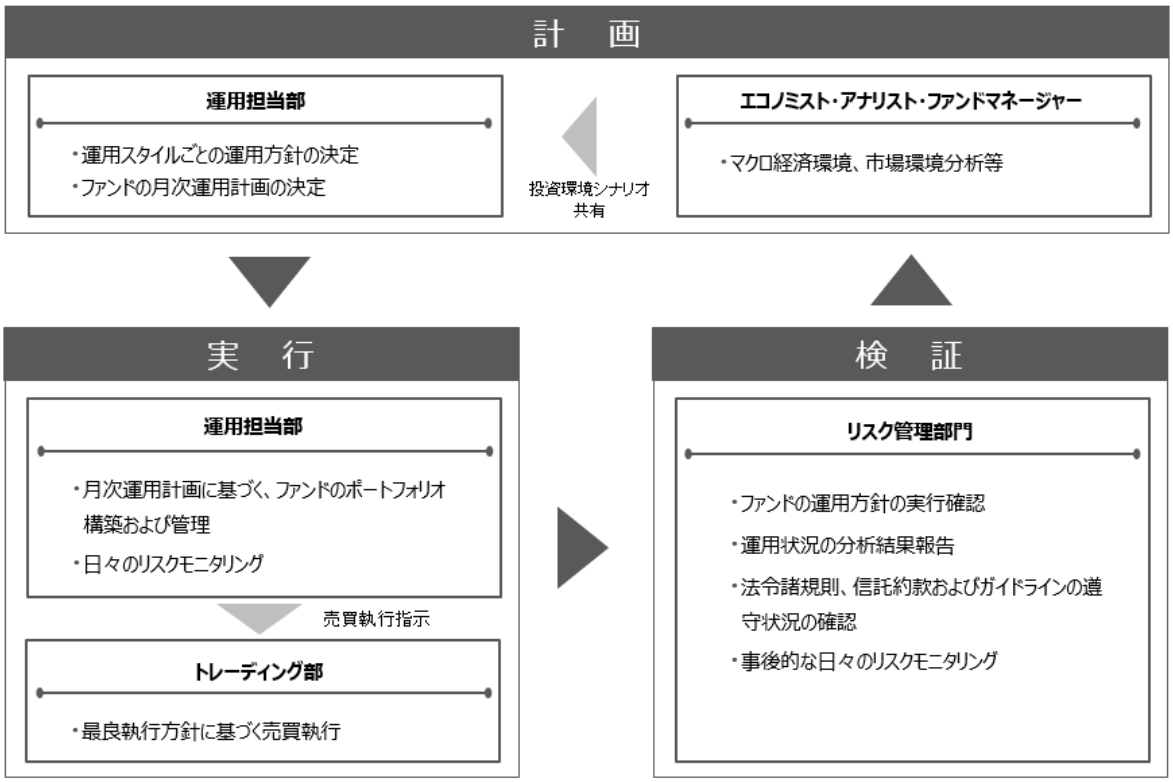
●各インデックスに関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は、指数を公表および許諾する各社に帰属します。また、当該各社は当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

●投資対象とする投資信託においてデリバティブ取引を行う場合は、価格変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

●投資対象とする投資信託において外国為替予約取引を行う場合は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

（3）【運用体制】

イ　ファンドの運用体制




※リスク管理部門の人員数は、約 40 名です。
※ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。
※他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）の組入れは、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上、選定しています。また、定性・定量面における評価を継続的に実施するとともに、投資対象としての適格性を定期的に判断します。

ロ　委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制
ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

（4）【分配方針】

年１回（原則として毎年９月 15 日。ただし、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

イ　分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。
ロ　収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
ハ　留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。
（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

（5）【投資制限】

## Ⅰ　ファンドの信託約款に基づく投資制限

イ　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

ロ　投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

ハ　外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

ニ　投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

ホ　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ヘ　公社債の借入れの指図

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

（ロ）公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

（ハ）信託財産の一部解約等の事由により、借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

（ニ）借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ト　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

チ　外国為替予約取引の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産（投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の対円での為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

リ　資金の借入れ

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内

2．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

3．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の 10%以内

（ハ）収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

（ニ）借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

## Ⅱ　法令に基づく投資制限

イ　同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第９条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第 879 条第３項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に 100 分の 50 を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

ロ　デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第 130 条第１項第８号）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

ハ　信用リスク集中回避のための投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第 130 条第１項第８号の２）

委託会社は、運用財産に関し、信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。）を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

３【投資リスク】

イ　ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資者の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

運用の結果として信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。また、一定の投資成果を保証するものではありません。

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

内外の経済動向や株式市場での需給動向等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況等によって変動し、株価が下落した場合はファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ロ）債券市場リスク

一般に債券は内外の経済情勢等の影響による金利の変動を受けて価格が変動します。通常、金利が上昇すると債券価格は下落します。また、格付けが引き下げられる場合も債券価格が下落するおそれがあります。債券価格の下落はファンドの基準価額が下落する要因となります。なお、価格の変動幅は、債券の種類、格付け、残存期間、利払いのしくみの違い等により、債券ごとに異なります。

（ハ）不動産投資信託（リート）に関するリスク

リートの価格は、不動産市況や金利・景気動向、関連法制度の変更等の影響を受け変動します。また、リートに組み入れられている個々の不動産等の市場価値や賃貸収入、個々のリートの事業活動や財務状況等によっても価格が変動します。これらにより、ファンドが組み入れているリートの価格が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ニ）信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品において債務不履行が発生あるいは懸念される場合、またはその発行体が経営不安や倒産等に陥った場合には、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ホ）為替変動リスク

ファンドは外貨建資産の一部について、原則として対円での為替ヘッジを行います。

為替ヘッジが行われていない部分については為替変動の影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落する（円高となる）場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。

為替ヘッジが行われている部分については為替変動の影響を受けますが、原則として対円での為替ヘッジを行うため、その影響は限定的と考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。対円での為替ヘッジ比率は、資産配分の調整に伴い変動します。なお、円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。また、需給要因等によっては金利差相当分以上にヘッジコストがかかる場合があります。

（ヘ）カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化、取引規制や税制の変更等によって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券等の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響

を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

（ト）流動性リスク

有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等に、十分な数量の売買ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

ロ　その他の留意点

（イ）投資信託に関する留意点

・当ファンドは一部、実質的に「ファミリーファンド方式」により運用します。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

・ファンドのお申込みに関しては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

・ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金申込みの受付けが中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

（ロ）分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

ハ　投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、運用リスク管理を行っています。

リスク管理担当部は、信託約款等に定める各種投資制限やリスク指標のモニタリングを実施し、制限に対する抵触等があった場合には運用部門に対処要請等を行い、結果をリスク管理会議へ報告します。

また、ファンドのパフォーマンスの分析・評価を行い、結果を運用評価会議等へ報告することで、運用方針等との整合性を維持するよう適切に管理しています。

さらに、流動性リスク管理について規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングやストレステストを実施するとともに、緊急時対応策等の策定や有効性の検証等を行います。なお、当該流動性リスクの適切な管理の実施等について、定期的にリスク管理会議へ報告します。

コンプライアンス担当部は、法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行い、結果をコンプライアンス会議に報告します。

## （参考情報）投資リスクの定量的比較

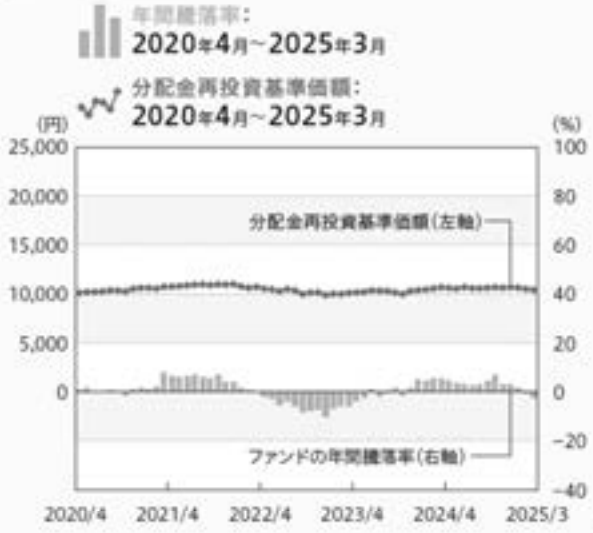
### ［ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移］

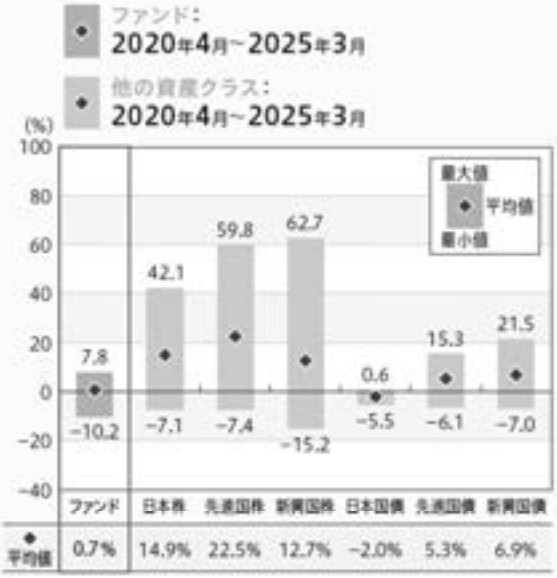
各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

### ［ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較］

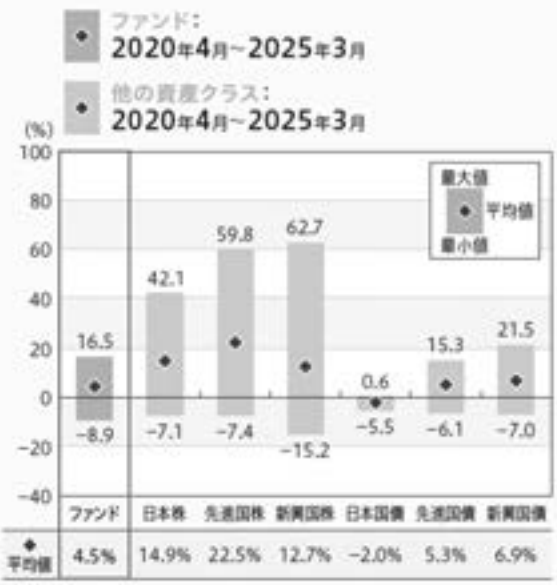
ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。

### □1安定重視型




### □2やや安定型




※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものとは異なります。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## ［ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移］

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

### □3バランス型

年間騰落率：
2020年4月～2025年3月

分配金再投資基準価額：
2020年4月～2025年3月

### □4やや成長型

年間騰落率：
2020年4月～2025年3月

分配金再投資基準価額：
2020年4月～2025年3月

※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

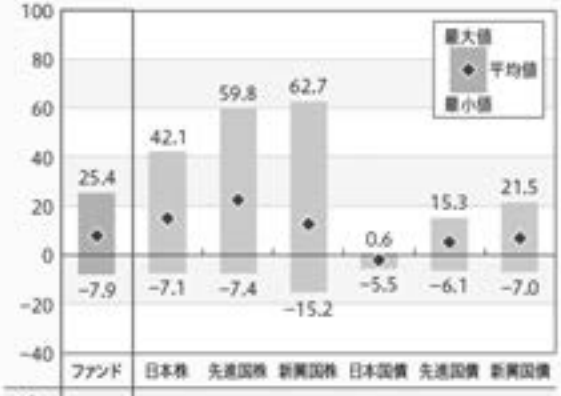
## ［ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較］

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。

### □3バランス型

ファンド：
2020年4月～2025年3月

他の資産クラス：
2020年4月～2025年3月

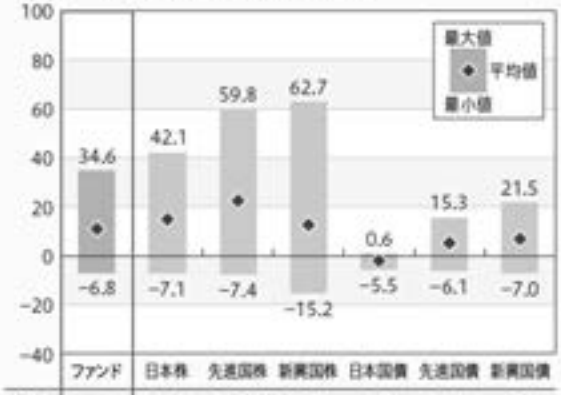



| | ファンド | 日本株 | 先進国株 | 新興国株 | 日本国債 | 先進国債 | 新興国債 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ◆平均値 | 7.9% | 14.9% | 22.5% | 12.7% | -2.0% | 5.3% | 6.9% |

### □4やや成長型

ファンド：
2020年4月～2025年3月

他の資産クラス：
2020年4月～2025年3月




| | ファンド | 日本株 | 先進国株 | 新興国株 | 日本国債 | 先進国債 | 新興国債 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ◆平均値 | 11.0% | 14.9% | 22.5% | 12.7% | -2.0% | 5.3% | 6.9% |

※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものとは異なります。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

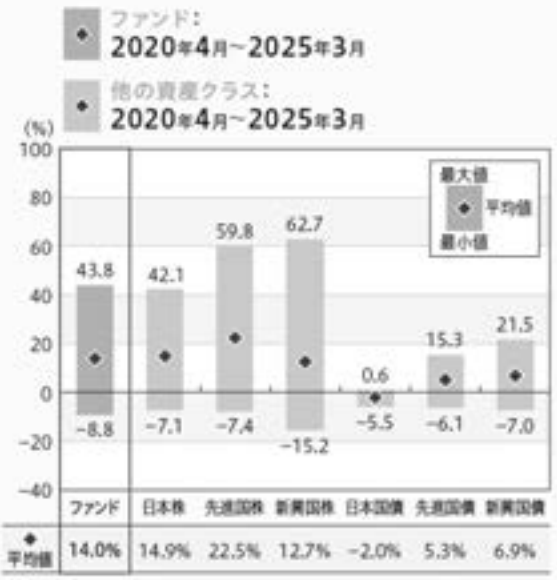
## ［ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移］

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

## ［ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較］

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。

### □5成長重視型




※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものとは異なります。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

| | |
|---|---|
| 日本株 | **TOPIX(東証株価指数、配当込み)**<br>株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社が算出、公表する指数で、日本の株式を対象としています。 |
| 先進国株 | **MSCIコクサイ・インデックス(グロス配当込み、円ベース)**<br>MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。 |
| 新興国株 | **MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース)**<br>MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。 |
| 日本国債 | **NOMURA-BPI(国債)**<br>野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。 |
| 先進国債 | **FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)**<br>FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。 |
| 新興国債 | **JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース)**<br>J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。 |

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。
※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

（3）【信託報酬等】

<table>
<tr><td rowspan="5"></td><td rowspan="4">ファンド</td><td colspan="3">純資産総額に年0.968%（税抜き0.88%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。<br>信託報酬の配分は以下の通りです。<br>＜信託報酬の配分（税抜き）＞</td></tr>
<tr><td>支払先</td><td>料率</td><td>役務の内容</td></tr>
<tr><td>委託会社<br>販売会社<br>受託会社</td><td>年0.39%<br>年0.46%<br>年0.03%</td><td>ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価<br>交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価<br>ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価</td></tr>
<tr><td colspan="3">※上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。<br>※委託会社の配分には、ファンドの運用に関して、助言を行う投資顧問会社に支払う投資顧問報酬が含まれています。</td></tr>
<tr><td>投資対象とする投資信託</td><td colspan="3">年0.39%程度（最大）*<br>※管理費用は、今後変更される場合があります。</td></tr>
<tr><td colspan="2">実質的な負担</td><td colspan="3">ファンドの純資産総額に対して年1.007%（最大）（税抜き0.919%）程度*<br>※実質的な負担は、基本資産配分比率の見直しおよび実際の組入状況等により変動します。<br>※ETFの基本資産配分比率を上限の10%と仮定して算出した試算値です。</td></tr>
</table>

＊投資対象とする投資信託の運用管理費用は、2025 年 3 月末現在で知り得る情報に基づくものであり、今後、変更される場合があります。

（4）【その他の手数料等】

イ　信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、原則として、計算期間を通じて毎日、信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

ロ　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、

信託財産中から支弁します。

ハ　有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、外国における資産の保管等に要する費用、およびマザーファンドの購入・換金に伴う信託財産留保額等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

※　上記にかかる費用に関しましては、変更される場合があるものや、その時々の取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなるものがあります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額等を具体的に記載することはできません。

※　上記（1）～（4）にかかる手数料等および他の投資信託（ファンド）の組入れを通じて間接的に負担する手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあったりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

（5）【課税上の取扱い】

イ　個別元本について

（イ）追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

（ロ）受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。

（ハ）受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

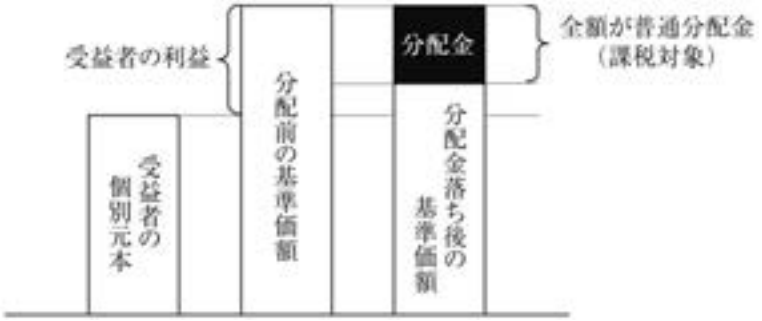
ロ　一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者については、一部解約時および償還時の譲渡益が課税対象となり、法人の受益者については、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

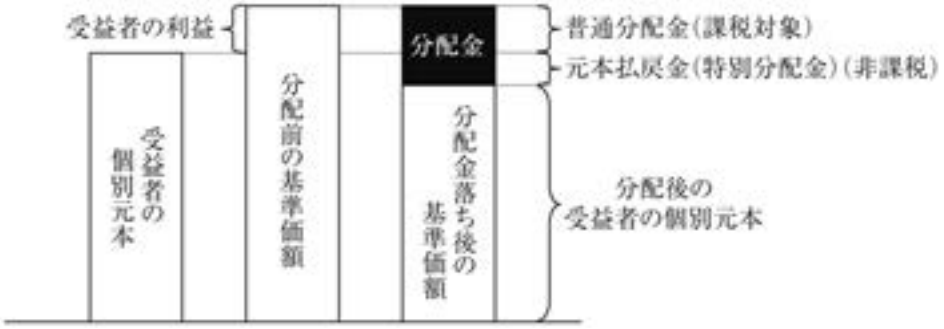
ハ　収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

①収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。



②収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。




※上記①、②の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

ニ　個人、法人別の課税の取扱いについて

（イ）個人の受益者に対する課税

ｉ．収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315％（所得税 15.315％および地方税５％）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

ⅱ．一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315％（所得税 15.315％および地方税５％）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（上場株式、公募株式投資信託、上場投資信託（ＥＴＦ）、上場不動産投資信託（ＲＥＩＴ）、公募公社債投資信託および特定公社債をいいます。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）および利子所得の金額との損益通算が可能です。

（ロ）法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315％（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

※課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等に確認されることをお勧めいたします。

※公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に限りＮＩＳＡ（少額投資非課税制度）の適用対象となります。

※当ファンドは、ＮＩＳＡの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが

異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした公募株式投資信託等を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2025 年 3 月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

## (参考情報) 総経費率

直近の運用報告書の対象期間(2023年9月16日～2024年9月17日)における当ファンドの総経費率(年率換算)は以下の通りです。
投資対象とする上場投資信託(ETF)(以下、投資先ファンド)の費用は、その他費用に含めています。なお、当ファンドの費用と投資先ファンドの費用の対象期間は、異なる場合があります。

| | 総経費率(①+②) | ①運用管理費用の比率 | ②その他費用の比率 |
|---|---|---|---|
| 1安定重視型 | 1.00% | 0.97% | 0.03% |
| 2やや安定型 | 1.01% | 0.97% | 0.04% |
| 3バランス型 | 1.01% | 0.97% | 0.05% |
| 4やや成長型 | 1.02% | 0.97% | 0.05% |
| 5成長重視型 | 1.02% | 0.97% | 0.06% |

※上記は、対象期間の運用報告書に記載されている総経費率(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含まれていません。投資先ファンドは、原則として、売買委託手数料、支払利息および有価証券にかかる税金は含まれていません。)です。
※当ファンドが上記以外の上場投資信託(ETF)および上場不動産投資信託(REIT)に投資している場合、当該ETFおよびREITの管理費用等は含まれていません。
※計算方法等の詳細は、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。
運用報告書は、委託会社のホームページ(https://www.smd-am.co.jp/fund/unpo/)から検索いただけます。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

2025 年 3 月 31 日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ | 117,459,845 | 0.86 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 13,482,938,033 | 98.26 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | － | 120,982,796 | 0.88 |
| 合計（純資産総額） | | 13,721,380,674 | 100.00 |

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。以下同じ。

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

2025 年 3 月 31 日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ | 133,299,557 | 1.76 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 7,365,566,069 | 97.29 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | － | 71,583,257 | 0.95 |
| 合計（純資産総額） | | 7,570,448,883 | 100.00 |

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

2025 年 3 月 31 日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ | 597,868,044 | 2.63 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 21,898,369,398 | 96.47 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | － | 203,578,922 | 0.90 |
| 合計（純資産総額） | | 22,699,816,364 | 100.00 |

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

2025 年 3 月 31 日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ | 399,993,278 | 3.60 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 10,592,816,035 | 95.45 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | － | 104,775,862 | 0.95 |
| 合計（純資産総額） | | 11,097,585,175 | 100.00 |

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

2025年3月31日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ | 568,391,583 | 4.60 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 11,687,845,180 | 94.50 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | － | 112,498,405 | 0.90 |
| 合計（純資産総額） | | 12,368,735,168 | 100.00 |

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

イ　主要投資銘柄

2025年3月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価（円） | 帳簿価額（円） | 評価額単価（円） | 評価額（円） | 投資比率（％） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 4,270,722,348 | 1.2005 | 5,127,143,864 | 1.1563 | 4,938,236,250 | 35.99 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 3,754,707,586 | 1.2419 | 4,662,810,816 | 1.2022 | 4,513,909,459 | 32.90 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス・マザーファンド | 156,202,231 | 8.9247 | 1,394,056,945 | 9.4135 | 1,470,409,701 | 10.72 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号） | 216,295,404 | 4.5785 | 990,309,054 | 4.8534 | 1,049,768,113 | 7.65 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 416,739,541 | 2.2319 | 930,137,958 | 2.3054 | 960,751,337 | 7.00 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 125,430,522 | 1.9871 | 249,239,235 | 2.1830 | 273,814,829 | 2.00 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | Ｊリート・インデックス・マザーファンド | 54,045,042 | 2.6053 | 140,805,857 | 2.5929 | 140,133,389 | 1.02 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 38,740,973 | 3.6007 | 139,494,621 | 3.5083 | 135,914,955 | 0.99 |
| アメリカ | 投資証券 | ｉシェアーズ Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ | 8,691 | 13,998.06 | 121,657,160 | 13,515.11 | 117,459,845 | 0.86 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ　種類別投資比率

2025年3月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 投資証券 | 0.86 |
| 親投資信託受益証券 | 98.26 |
| 合　計 | 99.12 |

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

イ　主要投資銘柄

2025年3月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価（円） | 帳簿価額（円） | 評価額単価（円） | 評価額（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 1,766,101,056 | 1.2415 | 2,192,550,268 | 1.2022 | 2,123,206,689 | 28.05 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 1,311,047,867 | 1.2005 | 1,573,872,977 | 1.1563 | 1,515,964,648 | 20.02 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス・マザーファンド | 148,832,020 | 8.8793 | 1,321,524,943 | 9.4135 | 1,401,030,220 | 18.51 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号） | 229,200,180 | 4.5762 | 1,048,871,338 | 4.8534 | 1,112,400,153 | 14.69 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 296,634,570 | 2.2339 | 662,664,807 | 2.3054 | 683,861,337 | 9.03 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 104,508,106 | 1.9920 | 208,177,034 | 2.1830 | 228,141,195 | 3.01 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | Ｊリート・インデックス・マザーファンド | 60,172,289 | 2.6035 | 156,661,036 | 2.5929 | 156,020,728 | 2.06 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 41,313,770 | 3.6052 | 148,945,482 | 3.5083 | 144,941,099 | 1.91 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 投資証券 | ｉシェアーズ Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ | 9,863 | 13,998.06 | 138,062,889 | 13,515.11 | 133,299,557 | 1.76 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ　種類別投資比率

2025年3月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 投資証券 | 1.76 |
| 親投資信託受益証券 | 97.29 |
| 合　計 | 99.05 |

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

イ　主要投資銘柄

2025年3月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価（円） | 帳簿価額（円） | 評価額単価（円） | 評価額（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス・マザーファンド | 618,381,902 | 8.8844 | 5,493,964,320 | 9.4135 | 5,821,138,034 | 25.64 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号） | 960,656,610 | 4.5831 | 4,402,776,069 | 4.8534 | 4,662,450,790 | 20.54 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 3,034,091,678 | 1.2405 | 3,763,725,083 | 1.2022 | 3,647,585,015 | 16.07 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 2,766,023,000 | 1.2002 | 3,319,703,492 | 1.1563 | 3,198,352,394 | 14.09 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 887,384,268 | 2.2361 | 1,984,290,405 | 2.3054 | 2,045,775,691 | 9.01 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 523,657,183 | 1.9950 | 1,044,720,882 | 2.1830 | 1,143,143,630 | 5.04 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | Ｊリート・インデックス・マザーファンド | 272,920,664 | 2.6006 | 709,769,439 | 2.5929 | 707,655,989 | 3.12 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 191,622,112 | 3.6090 | 691,571,509 | 3.5083 | 672,267,855 | 2.96 |
| アメリカ | 投資証券 | ｉシェアーズ Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエ | 44,237 | 13,998.06 | 619,232,286 | 13,515.11 | 597,868,044 | 2.63 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | マージング・マーケット債券ＥＴＦ | | | | | | |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ　種類別投資比率

2025年3月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 投資証券 | 2.63 |
| 親投資信託受益証券 | 96.47 |
| 合　計 | 99.10 |

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

イ　主要投資銘柄

2025年3月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価（円） | 帳簿価額（円） | 評価額単価（円） | 評価額（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス・マザーファンド | 382,796,688 | 8.8951 | 3,405,009,121 | 9.4135 | 3,603,456,622 | 32.47 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号） | 582,630,277 | 4.5849 | 2,671,301,850 | 4.8534 | 2,827,737,786 | 25.48 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 841,964,036 | 1.2406 | 1,044,511,933 | 1.2022 | 1,012,209,164 | 9.12 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 679,055,799 | 1.2003 | 815,100,765 | 1.1563 | 785,192,220 | 7.08 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 355,860,119 | 1.9955 | 710,126,374 | 2.1830 | 776,842,639 | 7.00 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 295,201,737 | 2.2375 | 660,518,269 | 2.3054 | 680,558,084 | 6.13 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | Ｊリート・インデックス・マザーファンド | 178,584,175 | 2.6019 | 464,663,769 | 2.5929 | 463,050,907 | 4.17 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 126,491,068 | 3.6064 | 456,171,522 | 3.5083 | 443,768,613 | 4.00 |
| アメリカ | 投資証券 | ｉシェアーズ Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ | 29,596 | 13,964.94 | 413,306,364 | 13,515.11 | 399,993,278 | 3.60 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ　種類別投資比率

2025年3月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 投資証券 | 3.60 |
| 親投資信託受益証券 | 95.45 |
| 合　計 | 99.06 |

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

イ　主要投資銘柄

2025年3月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価（円） | 帳簿価額（円） | 評価額単価（円） | 評価額（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス・マザーファンド | 568,883,538 | 8.9148 | 5,071,501,320 | 9.4135 | 5,355,185,184 | 43.30 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号） | 759,524,803 | 4.5950 | 3,489,999,786 | 4.8534 | 3,686,277,678 | 29.80 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 567,405,773 | 2.0012 | 1,135,468,878 | 2.1830 | 1,238,646,802 | 10.01 |
| アメリカ | 投資証券 | ｉシェアーズ Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ | 42,056 | 13,954.67 | 586,877,640 | 13,515.11 | 568,391,583 | 4.60 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | Ｊリート・インデックス・マザーファンド | 150,915,800 | 2.5992 | 392,262,008 | 2.5929 | 391,309,577 | 3.16 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 167,611,626 | 2.2413 | 375,673,462 | 2.3054 | 386,411,842 | 3.12 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 105,275,637 | 3.6107 | 380,121,767 | 3.5083 | 369,338,517 | 2.99 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 109,616,312 | 1.2405 | 135,982,943 | 1.2022 | 131,780,730 | 1.07 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 111,471,807 | 1.1994 | 133,701,146 | 1.1563 | 128,894,850 | 1.04 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ　種類別投資比率

2025年3月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 投資証券 | 4.60 |
| 親投資信託受益証券 | 94.50 |
| 合　計 | 99.09 |

②【投資不動産物件】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

| 年月日 | 純資産総額（円） | | １万口当たりの純資産額（円） | |
|---|---|---|---|---|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| 第１期　（2018年 9月 18日） | 188,363,034 | 188,363,034 | 9,891 | 9,891 |
| 第２期　（2019年 9月 17日） | 1,356,985,451 | 1,356,985,451 | 10,327 | 10,327 |
| 第３期　（2020年 9月 15日） | 3,201,120,313 | 3,201,120,313 | 10,352 | 10,352 |
| 第４期　（2021年 9月 15日） | 6,014,936,981 | 6,014,936,981 | 10,987 | 10,987 |
| 第５期　（2022年 9月 15日） | 7,936,728,790 | 7,936,728,790 | 10,277 | 10,277 |
| 第６期　（2023年 9月 15日） | 10,436,090,722 | 10,436,090,722 | 10,277 | 10,277 |
| 第７期　（2024年 9月 17日） | 12,849,987,395 | 12,849,987,395 | 10,526 | 10,526 |
| 2024年 3月末日 | 11,953,111,482 | － | 10,649 | － |
| 4月末日 | 12,030,399,519 | － | 10,580 | － |
| 5月末日 | 12,083,365,826 | － | 10,519 | － |
| 6月末日 | 12,519,698,831 | － | 10,666 | － |
| 7月末日 | 12,532,291,298 | － | 10,555 | － |
| 8月末日 | 12,840,411,587 | － | 10,555 | － |
| 9月末日 | 13,081,729,378 | － | 10,600 | － |
| 10月末日 | 13,363,946,820 | － | 10,649 | － |
| 11月末日 | 13,444,208,111 | － | 10,611 | － |
| 12月末日 | 13,578,510,470 | － | 10,659 | － |
| 2025年 1月末日 | 13,680,141,347 | － | 10,615 | － |
| 2月末日 | 13,672,694,883 | － | 10,494 | － |
| 3月末日 | 13,721,380,674 | － | 10,392 | － |

（注）各月末日の数字は最終営業日のものです。

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

| 年月日 | 純資産総額（円） | | １万口当たりの純資産額（円） | |
|---|---|---|---|---|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| 第１期　（2018年 9月18日） | 95,425,714 | 95,425,714 | 10,023 | 10,023 |
| 第２期　（2019年 9月17日） | 680,523,123 | 680,523,123 | 10,310 | 10,310 |
| 第３期　（2020年 9月15日） | 1,423,870,207 | 1,423,870,207 | 10,504 | 10,504 |
| 第４期　（2021年 9月15日） | 2,948,746,361 | 2,948,746,361 | 11,770 | 11,770 |
| 第５期　（2022年 9月15日） | 3,963,474,003 | 3,963,474,003 | 11,317 | 11,317 |
| 第６期　（2023年 9月15日） | 5,248,052,720 | 5,248,052,720 | 11,802 | 11,802 |
| 第７期　（2024年 9月17日） | 6,888,491,904 | 6,888,491,904 | 12,399 | 12,399 |
| 2024年 3月末日 | 6,475,823,430 | － | 12,592 | － |
| 4月末日 | 6,536,850,147 | － | 12,559 | － |
| 5月末日 | 6,642,357,682 | － | 12,559 | － |
| 6月末日 | 6,894,384,242 | － | 12,825 | － |
| 7月末日 | 6,947,399,774 | － | 12,612 | － |
| 8月末日 | 6,942,505,722 | － | 12,532 | － |
| 9月末日 | 7,063,798,533 | － | 12,583 | － |
| 10月末日 | 7,303,111,153 | － | 12,780 | － |
| 11月末日 | 7,359,880,406 | － | 12,733 | － |
| 12月末日 | 7,533,982,331 | － | 12,893 | － |
| 2025年 1月末日 | 7,623,868,175 | － | 12,852 | － |
| 2月末日 | 7,551,928,140 | － | 12,619 | － |
| 3月末日 | 7,570,448,883 | － | 12,483 | － |

（注）各月末日の数字は最終営業日のものです。

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

| 年月日 | 純資産総額（円） | | １万口当たりの純資産額（円） | |
|---|---|---|---|---|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| 第１期　（2018年 9月18日） | 294,119,586 | 294,119,586 | 10,265 | 10,265 |
| 第２期　（2019年 9月17日） | 1,355,636,779 | 1,355,636,779 | 10,443 | 10,443 |
| 第３期　（2020年 9月15日） | 3,340,276,783 | 3,340,276,783 | 10,752 | 10,752 |
| 第４期　（2021年 9月15日） | 7,103,911,189 | 7,103,911,189 | 12,649 | 12,649 |
| 第５期　（2022年 9月15日） | 10,302,370,297 | 10,302,370,297 | 12,461 | 12,461 |
| 第６期　（2023年 9月15日） | 14,715,183,751 | 14,715,183,751 | 13,483 | 13,483 |
| 第７期　（2024年 9月17日） | 20,158,543,951 | 20,158,543,951 | 14,461 | 14,461 |
| 2024年 3月末日 | 18,457,673,206 | － | 14,742 | － |
| 4月末日 | 18,722,693,692 | － | 14,760 | － |
| 5月末日 | 19,214,412,344 | － | 14,830 | － |
| 6月末日 | 20,194,317,002 | － | 15,237 | － |
| 7月末日 | 20,218,263,626 | － | 14,897 | － |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 8月末日 | 20,400,571,367 | － | 14,729 | － |
| 9月末日 | 20,793,069,706 | － | 14,790 | － |
| 10月末日 | 21,789,911,859 | － | 15,178 | － |
| 11月末日 | 21,873,090,154 | － | 15,096 | － |
| 12月末日 | 22,583,189,870 | － | 15,407 | － |
| 2025年 1月末日 | 22,885,674,788 | － | 15,367 | － |
| 2月末日 | 22,481,803,565 | － | 14,985 | － |
| 3月末日 | 22,699,816,364 | － | 14,803 | － |

（注）各月末日の数字は最終営業日のものです。

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

| 年月日 | 純資産総額（円） | | １万口当たりの純資産額（円） | |
|---|---|---|---|---|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| 第1期 （2018年 9月18日） | 198,459,464 | 198,459,464 | 10,365 | 10,365 |
| 第2期 （2019年 9月17日） | 635,299,500 | 635,299,500 | 10,455 | 10,455 |
| 第3期 （2020年 9月15日） | 1,407,129,947 | 1,407,129,947 | 10,813 | 10,813 |
| 第4期 （2021年 9月15日） | 2,920,936,967 | 2,920,936,967 | 13,299 | 13,299 |
| 第5期 （2022年 9月15日） | 4,630,827,047 | 4,630,827,047 | 13,380 | 13,380 |
| 第6期 （2023年 9月15日） | 6,893,523,523 | 6,893,523,523 | 14,948 | 14,948 |
| 第7期 （2024年 9月17日） | 9,822,086,304 | 9,822,086,304 | 16,320 | 16,320 |
| 2024年 3月末日 | 8,919,497,449 | － | 16,691 | － |
| 4月末日 | 9,130,159,671 | － | 16,758 | － |
| 5月末日 | 9,367,771,499 | － | 16,903 | － |
| 6月末日 | 9,892,345,657 | － | 17,453 | － |
| 7月末日 | 9,860,442,520 | － | 16,982 | － |
| 8月末日 | 9,960,899,532 | － | 16,725 | － |
| 9月末日 | 10,142,057,869 | － | 16,806 | － |
| 10月末日 | 10,714,309,783 | － | 17,386 | － |
| 11月末日 | 10,710,140,165 | － | 17,279 | － |
| 12月末日 | 11,116,332,936 | － | 17,738 | － |
| 2025年 1月末日 | 11,247,846,894 | － | 17,715 | － |
| 2月末日 | 11,107,274,411 | － | 17,179 | － |
| 3月末日 | 11,097,585,175 | － | 16,937 | － |

（注）各月末日の数字は最終営業日のものです。

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

| 年月日 | 純資産総額（円） | | １万口当たりの純資産額（円） | |
|---|---|---|---|---|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 第1期 (2018年 9月18日) | 475,256,788 | 475,256,788 | 10,445 | 10,445 |
| 第2期 (2019年 9月17日) | 758,503,160 | 758,503,160 | 10,399 | 10,399 |
| 第3期 (2020年 9月15日) | 1,374,244,182 | 1,374,244,182 | 10,821 | 10,821 |
| 第4期 (2021年 9月15日) | 2,928,938,274 | 2,928,938,274 | 13,753 | 13,753 |
| 第5期 (2022年 9月15日) | 4,578,888,251 | 4,578,888,251 | 14,067 | 14,067 |
| 第6期 (2023年 9月15日) | 6,908,100,522 | 6,908,100,522 | 16,214 | 16,214 |
| 第7期 (2024年 9月17日) | 10,529,858,478 | 10,529,858,478 | 18,060 | 18,060 |
| 2024年 3月末日 | 9,346,476,347 | − | 18,568 | − |
| 4月末日 | 9,666,384,841 | − | 18,721 | − |
| 5月末日 | 10,069,392,204 | − | 18,975 | − |
| 6月末日 | 10,727,913,749 | − | 19,725 | − |
| 7月末日 | 10,748,285,934 | − | 19,038 | − |
| 8月末日 | 10,793,896,652 | − | 18,644 | − |
| 9月末日 | 11,017,261,427 | − | 18,763 | − |
| 10月末日 | 11,673,915,768 | − | 19,617 | − |
| 11月末日 | 11,741,251,008 | − | 19,478 | − |
| 12月末日 | 12,326,336,540 | − | 20,162 | − |
| 2025年 1月末日 | 12,567,832,573 | − | 20,147 | − |
| 2月末日 | 12,308,790,551 | − | 19,395 | − |
| 3月末日 | 12,368,735,168 | − | 19,066 | − |

（注）各月末日の数字は最終営業日のものです。

②【分配の推移】

三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）

| | 計算期間 | 1万口当たり分配金（円） |
|---|---|---|
| 第1期 | 2017年 9月14日～2018年 9月18日 | 0 |
| 第2期 | 2018年 9月19日～2019年 9月17日 | 0 |
| 第3期 | 2019年 9月18日～2020年 9月15日 | 0 |
| 第4期 | 2020年 9月16日～2021年 9月15日 | 0 |
| 第5期 | 2021年 9月16日～2022年 9月15日 | 0 |
| 第6期 | 2022年 9月16日～2023年 9月15日 | 0 |
| 第7期 | 2023年 9月16日～2024年 9月17日 | 0 |

三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

| | 計算期間 | 1万口当たり分配金（円） |
|---|---|---|
| 第1期 | 2017年 9月14日～2018年 9月18日 | 0 |
| 第2期 | 2018年 9月19日～2019年 9月17日 | 0 |
| 第3期 | 2019年 9月18日～2020年 9月15日 | 0 |
| 第4期 | 2020年 9月16日～2021年 9月15日 | 0 |

| | | |
|---|---|---|
| 第５期 | 2021年９月16日～2022年９月15日 | 0 |
| 第６期 | 2022年９月16日～2023年９月15日 | 0 |
| 第７期 | 2023年９月16日～2024年９月17日 | 0 |

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

| | 計算期間 | １万口当たり分配金（円） |
|---|---|---|
| 第１期 | 2017年９月14日～2018年９月18日 | 0 |
| 第２期 | 2018年９月19日～2019年９月17日 | 0 |
| 第３期 | 2019年９月18日～2020年９月15日 | 0 |
| 第４期 | 2020年９月16日～2021年９月15日 | 0 |
| 第５期 | 2021年９月16日～2022年９月15日 | 0 |
| 第６期 | 2022年９月16日～2023年９月15日 | 0 |
| 第７期 | 2023年９月16日～2024年９月17日 | 0 |

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

| | 計算期間 | １万口当たり分配金（円） |
|---|---|---|
| 第１期 | 2017年９月14日～2018年９月18日 | 0 |
| 第２期 | 2018年９月19日～2019年９月17日 | 0 |
| 第３期 | 2019年９月18日～2020年９月15日 | 0 |
| 第４期 | 2020年９月16日～2021年９月15日 | 0 |
| 第５期 | 2021年９月16日～2022年９月15日 | 0 |
| 第６期 | 2022年９月16日～2023年９月15日 | 0 |
| 第７期 | 2023年９月16日～2024年９月17日 | 0 |

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

| | 計算期間 | １万口当たり分配金（円） |
|---|---|---|
| 第１期 | 2017年９月14日～2018年９月18日 | 0 |
| 第２期 | 2018年９月19日～2019年９月17日 | 0 |
| 第３期 | 2019年９月18日～2020年９月15日 | 0 |
| 第４期 | 2020年９月16日～2021年９月15日 | 0 |
| 第５期 | 2021年９月16日～2022年９月15日 | 0 |
| 第６期 | 2022年９月16日～2023年９月15日 | 0 |
| 第７期 | 2023年９月16日～2024年９月17日 | 0 |

③【収益率の推移】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

| | 収益率（％） |
|---|---|

| | |
|---|---|
| 第１期 | △1.1 |
| 第２期 | 4.4 |
| 第３期 | 0.2 |
| 第４期 | 6.1 |
| 第５期 | △6.5 |
| 第６期 | 0.0 |
| 第７期 | 2.4 |
| 第８期（中間期） | △1.4 |

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

| | 収益率（％） |
|---|---|
| 第１期 | 0.2 |
| 第２期 | 2.9 |
| 第３期 | 1.9 |
| 第４期 | 12.1 |
| 第５期 | △3.8 |
| 第６期 | 4.3 |
| 第７期 | 5.1 |
| 第８期（中間期） | 0.8 |

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

| | 収益率（％） |
|---|---|
| 第１期 | 2.7 |
| 第２期 | 1.7 |
| 第３期 | 3.0 |
| 第４期 | 17.6 |
| 第５期 | △1.5 |
| 第６期 | 8.2 |
| 第７期 | 7.3 |
| 第８期（中間期） | 2.7 |

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

| | 収益率（％） |
|---|---|

| | |
|---|---|
| 第１期 | 3.7 |
| 第２期 | 0.9 |
| 第３期 | 3.4 |
| 第４期 | 23.0 |
| 第５期 | 0.6 |
| 第６期 | 11.7 |
| 第７期 | 9.2 |
| 第８期（中間期） | 4.3 |

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

| | 収益率（％） |
|---|---|
| 第１期 | 4.5 |
| 第２期 | △0.4 |
| 第３期 | 4.1 |
| 第４期 | 27.1 |
| 第５期 | 2.3 |
| 第６期 | 15.3 |
| 第７期 | 11.4 |
| 第８期（中間期） | 6.4 |

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

（４）【設定及び解約の実績】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

| | 設定口数（口） | 解約口数（口） |
|---|---|---|
| 第１期 | 197,260,985 | 6,814,601 |
| 第２期 | 1,242,016,819 | 118,444,252 |
| 第３期 | 2,142,530,997 | 364,184,551 |
| 第４期 | 3,074,461,766 | 692,313,957 |
| 第５期 | 3,272,525,772 | 1,024,474,042 |
| 第６期 | 3,585,355,935 | 1,152,978,488 |
| 第７期 | 3,763,691,049 | 1,710,844,062 |
| 第８期（中間期） | 1,892,889,635 | 903,629,312 |

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

| | 設定口数（口） | 解約口数（口） |
|---|---|---|
| 第１期 | 235,257,377 | 140,052,522 |
| 第２期 | 593,034,885 | 28,199,968 |
| 第３期 | 853,822,366 | 158,356,618 |
| 第４期 | 1,391,060,134 | 241,319,938 |
| 第５期 | 1,327,482,394 | 330,475,830 |
| 第６期 | 1,371,817,336 | 427,265,280 |
| 第７期 | 1,652,333,710 | 543,610,418 |
| 第８期（中間期） | 703,180,055 | 231,080,925 |

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

| | 設定口数（口） | 解約口数（口） |
|---|---|---|
| 第１期 | 426,008,460 | 139,473,752 |
| 第２期 | 1,111,549,352 | 100,006,600 |
| 第３期 | 2,085,818,899 | 277,142,914 |
| 第４期 | 2,996,875,916 | 487,585,479 |
| 第５期 | 3,415,030,451 | 763,606,832 |
| 第６期 | 3,603,123,946 | 956,915,168 |
| 第７期 | 4,235,031,216 | 1,208,617,793 |
| 第８期（中間期） | 1,887,993,710 | 650,377,720 |

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

| | 設定口数（口） | 解約口数（口） |
|---|---|---|
| 第１期 | 411,158,724 | 219,693,175 |
| 第２期 | 485,641,046 | 69,477,173 |
| 第３期 | 839,231,080 | 145,565,103 |
| 第４期 | 1,186,838,860 | 291,846,934 |
| 第５期 | 1,638,627,128 | 373,806,038 |
| 第６期 | 1,655,293,434 | 504,703,539 |
| 第７期 | 1,970,467,183 | 563,673,748 |
| 第８期（中間期） | 843,599,630 | 363,014,534 |

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

| | 設定口数（口） | 解約口数（口） |
|---|---|---|
| 第１期 | 762,271,388 | 307,261,790 |
| 第２期 | 481,502,084 | 207,078,502 |

| | | |
|---|---|---|
| 第3期 | 843,783,098 | 303,192,666 |
| 第4期 | 1,274,331,650 | 414,699,900 |
| 第5期 | 1,564,567,682 | 439,177,712 |
| 第6期 | 1,671,376,606 | 665,761,266 |
| 第7期 | 2,248,982,809 | 679,089,448 |
| 第8期（中間期） | 955,594,851 | 370,123,177 |

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

（1）投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2025年3月31日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 株式 | 日本 | 351,036,006,445 | 98.02 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 7,094,018,200 | 1.98 |
| 合計（純資産総額） | | 358,130,024,645 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本 | 6,814,720,000 | 1.90 |
| 合計 | 買建 | - | 6,814,720,000 | 1.90 |

外国株式インデックス・マザーファンド

2025年3月31日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 株式 | アメリカ | 640,297,204,295 | 70.17 |
| | イギリス | 34,873,769,792 | 3.82 |
| | カナダ | 29,998,921,427 | 3.29 |
| | スイス | 26,605,601,343 | 2.92 |
| | フランス | 25,206,019,527 | 2.76 |
| | ドイツ | 23,953,579,147 | 2.63 |
| | アイルランド | 16,234,654,081 | 1.78 |
| | オランダ | 14,912,827,295 | 1.63 |
| | オーストラリア | 14,257,320,386 | 1.56 |
| | スウェーデン | 7,727,993,833 | 0.85 |
| | スペイン | 7,238,146,106 | 0.79 |
| | イタリア | 6,151,939,484 | 0.67 |
| | デンマーク | 5,731,181,437 | 0.63 |
| | 香港 | 3,474,684,259 | 0.38 |
| | シンガポール | 3,067,466,901 | 0.34 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | フィンランド | 2,457,738,244 | 0.27 |
| | イスラエル | 2,209,414,221 | 0.24 |
| | ベルギー | 1,836,707,625 | 0.20 |
| | ルクセンブルグ | 1,713,823,561 | 0.19 |
| | ジャージィー | 1,705,984,586 | 0.19 |
| | ノルウェー | 1,547,840,321 | 0.17 |
| | ケイマン諸島 | 1,530,523,530 | 0.17 |
| | バミューダ | 994,421,814 | 0.11 |
| | オランダ領キュラソー | 826,651,887 | 0.09 |
| | リベリア | 736,485,553 | 0.08 |
| | ニュージーランド | 662,604,223 | 0.07 |
| | オーストリア | 473,570,076 | 0.05 |
| | ポルトガル | 338,197,241 | 0.04 |
| | パナマ | 299,235,332 | 0.03 |
| | マン島 | 50,039,592 | 0.01 |
| | 小計 | 877,114,547,119 | 96.12 |
| 新株予約権証券 | カナダ | - | 0.00 |
| 投資証券 | アメリカ | 14,984,367,868 | 1.64 |
| | オーストラリア | 1,369,732,496 | 0.15 |
| | フランス | 354,576,240 | 0.04 |
| | シンガポール | 233,586,006 | 0.03 |
| | イギリス | 220,088,831 | 0.02 |
| | 香港 | 167,544,103 | 0.02 |
| | ケイマン諸島 | 86,511,142 | 0.01 |
| | 小計 | 17,416,406,686 | 1.91 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 17,968,845,160 | 1.97 |
| 合計（純資産総額） | | 912,499,798,965 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | 買建 | イギリス | 739,043,412 | 0.08 |
| 株価指数先物取引 | 買建 | ドイツ | 2,579,078,550 | 0.28 |
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 14,376,841,416 | 1.58 |
| 株価指数先物取引 | 買建 | オーストラリア | 489,865,610 | 0.05 |
| 合計 | 買建 | - | 18,184,828,988 | 1.99 |

| 種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | 買建 | - | 3,553,826,332 | 0.39 |

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2025年3月31日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計<br>（円） | 投資比率<br>（％） |
|---|---|---|---|
| 株式 | ケイマン諸島 | 10,603,808,752 | 18.28 |
| | インド | 9,945,755,573 | 17.14 |
| | 台湾 | 9,255,275,977 | 15.95 |
| | 韓国 | 4,976,596,456 | 8.58 |
| | 中国 | 3,898,432,895 | 6.72 |
| | ブラジル | 2,030,698,924 | 3.50 |
| | 南アフリカ | 1,527,740,328 | 2.63 |
| | メキシコ | 757,897,093 | 1.31 |
| | マレーシア | 721,024,085 | 1.24 |
| | インドネシア | 668,735,098 | 1.15 |
| | タイ | 636,011,163 | 1.10 |
| | ポーランド | 516,728,019 | 0.89 |
| | 香港 | 444,813,414 | 0.77 |
| | ギリシャ | 311,988,766 | 0.54 |
| | トルコ | 306,833,963 | 0.53 |
| | フィリピン | 260,727,793 | 0.45 |
| | チリ | 251,746,818 | 0.43 |
| | バミューダ | 217,620,755 | 0.38 |
| | アメリカ | 188,937,760 | 0.33 |
| | ハンガリー | 155,819,451 | 0.27 |
| | イギリス | 123,673,302 | 0.21 |
| | チェコ | 90,232,446 | 0.16 |
| | ルクセンブルグ | 67,542,853 | 0.12 |
| | コロンビア | 63,676,193 | 0.11 |
| | エジプト | 36,394,981 | 0.06 |
| | オランダ | 30,177,262 | 0.05 |
| | ペルー | 15,188,752 | 0.03 |
| | シンガポール | 12,224,400 | 0.02 |
| | 小計 | 48,116,303,272 | 82.94 |
| 投資信託受益証券 | 香港 | 2,153,082,890 | 3.71 |
| 投資証券 | アメリカ | 3,783,630,096 | 6.52 |
| | メキシコ | 258,277,563 | 0.45 |
| | ブラジル | 78,008,800 | 0.13 |
| | 小計 | 4,119,916,459 | 7.10 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | － | 3,626,210,321 | 6.25 |
| 合計（純資産総額） | | 58,015,512,942 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建／<br>売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率<br>（％） |
|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 3,722,399,830 | 6.42 |
| 合計 | 買建 | － | 3,722,399,830 | 6.42 |

| 種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | 買建 | - | 240,140,067 | 0.41 |
| 為替予約取引 | 売建 | - | 341,693 | △0.00 |

Ｊリート・インデックス・マザーファンド

2025年3月31日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 投資証券 | 日本 | 20,338,566,550 | 98.59 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 291,388,539 | 1.41 |
| 合計（純資産総額） | | 20,629,955,089 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| リート指数先物取引 | 買建 | 日本 | 33,670,000 | 0.16 |
| 合計 | 買建 | - | 33,670,000 | 0.16 |

外国リート・インデックス・マザーファンド

2025年3月31日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ | 35,159,992,172 | 78.52 |
| | オーストラリア | 3,032,096,859 | 6.77 |
| | イギリス | 1,883,511,626 | 4.21 |
| | シンガポール | 1,363,513,164 | 3.05 |
| | フランス | 847,747,510 | 1.89 |
| | カナダ | 548,655,264 | 1.23 |
| | ベルギー | 431,342,907 | 0.96 |
| | 香港 | 421,283,660 | 0.94 |
| | スペイン | 191,646,750 | 0.43 |
| | 韓国 | 69,649,082 | 0.16 |
| | オランダ | 67,946,897 | 0.15 |
| | イスラエル | 54,253,876 | 0.12 |
| | ガーンジィ | 42,921,592 | 0.10 |
| | ニュージーランド | 34,422,059 | 0.08 |
| | アイルランド | 15,000,750 | 0.03 |
| | ドイツ | 13,671,221 | 0.03 |
| | イタリア | 3,644,149 | 0.01 |
| | 小計 | 44,181,299,538 | 98.67 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 594,429,479 | 1.33 |
| 合計（純資産総額） | | 44,775,729,017 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | 買建 | - | 92,653,705 | 0.21 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

2025年3月31日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 国債証券 | 日本 | 98,806,862,640 | 77.36 |
| 地方債証券 | 日本 | 10,513,429,750 | 8.23 |
| 特殊債券 | 日本 | 9,929,642,461 | 7.77 |
| 社債券 | 日本 | 7,771,960,500 | 6.09 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 698,315,688 | 0.55 |
| 合計（純資産総額） | | 127,720,211,039 | 100.00 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

2025年3月31日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 国債証券 | アメリカ | 93,403,673,171 | 46.63 |
| | 中国 | 22,071,592,295 | 11.02 |
| | フランス | 14,258,174,131 | 7.12 |
| | イタリア | 13,381,895,872 | 6.68 |
| | ドイツ | 11,220,095,329 | 5.60 |
| | イギリス | 10,412,581,820 | 5.20 |
| | スペイン | 8,592,745,821 | 4.29 |
| | カナダ | 3,901,970,344 | 1.95 |
| | ベルギー | 3,050,399,783 | 1.52 |
| | オランダ | 2,507,953,194 | 1.25 |
| | オーストラリア | 2,436,498,861 | 1.22 |
| | オーストリア | 2,222,925,708 | 1.11 |
| | メキシコ | 1,553,604,169 | 0.78 |
| | ポーランド | 1,185,107,819 | 0.59 |
| | ポルトガル | 1,180,379,886 | 0.59 |
| | マレーシア | 1,009,563,670 | 0.50 |
| | フィンランド | 1,001,243,251 | 0.50 |
| | アイルランド | 930,103,292 | 0.46 |
| | シンガポール | 775,176,358 | 0.39 |
| | イスラエル | 634,314,420 | 0.32 |
| | ニュージーランド | 557,496,536 | 0.28 |
| | デンマーク | 436,113,490 | 0.22 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | スウェーデン | 363,524,518 | 0.18 |
| | ノルウェー | 297,383,532 | 0.15 |
| | 小計 | 197,384,517,270 | 98.54 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 2,914,825,989 | 1.46 |
| 合計（純資産総額） | | 200,299,343,259 | 100.00 |

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2025年3月31日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|
| 国債証券 | アメリカ | 16,396,652,595 | 46.92 |
| | 中国 | 3,876,323,978 | 11.09 |
| | フランス | 2,505,570,262 | 7.17 |
| | イタリア | 2,354,002,252 | 6.74 |
| | ドイツ | 1,970,962,494 | 5.64 |
| | イギリス | 1,836,221,684 | 5.25 |
| | スペイン | 1,517,515,978 | 4.34 |
| | カナダ | 686,575,010 | 1.96 |
| | ベルギー | 536,787,759 | 1.54 |
| | オランダ | 441,240,254 | 1.26 |
| | オーストラリア | 429,467,604 | 1.23 |
| | オーストリア | 390,474,254 | 1.12 |
| | シンガポール | 311,658,303 | 0.89 |
| | メキシコ | 271,850,676 | 0.78 |
| | ポルトガル | 208,160,494 | 0.60 |
| | ポーランド | 205,630,505 | 0.59 |
| | フィンランド | 167,415,106 | 0.48 |
| | アイルランド | 150,948,977 | 0.43 |
| | イスラエル | 109,813,167 | 0.31 |
| | ニュージーランド | 98,513,470 | 0.28 |
| | デンマーク | 75,127,069 | 0.21 |
| | スウェーデン | 58,184,246 | 0.17 |
| | ノルウェー | 50,573,850 | 0.14 |
| | 小計 | 34,649,669,987 | 99.14 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 299,653,934 | 0.86 |
| 合計（純資産総額） | | 34,949,323,921 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建／売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | 買建 | - | 260,510,350 | 0.75 |
| 為替予約取引 | 売建 | - | 35,475,059,267 | △101.50 |

（２）投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

イ　主要投資銘柄（上位 30 銘柄）

2025 年 3 月 31 日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿単価（円） | 帳簿価額（円） | 評価額単価（円） | 評価額（円） | 投資比率（％） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 4,930,400 | 2,625.85 | 12,946,514,317 | 2,616.00 | 12,897,926,400 | 3.60 |
| 日本 | 株式 | ソニーグループ | 電気機器 | 3,198,800 | 3,031.57 | 9,697,392,417 | 3,765.00 | 12,043,482,000 | 3.36 |
| 日本 | 株式 | 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 5,858,400 | 1,832.27 | 10,734,172,016 | 2,011.00 | 11,781,242,400 | 3.29 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 2,382,300 | 3,942.00 | 9,391,023,498 | 3,458.00 | 8,237,993,400 | 2.30 |
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 1,886,800 | 3,823.37 | 7,213,930,018 | 3,795.00 | 7,160,406,000 | 2.00 |
| 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 585,500 | 8,918.59 | 5,221,834,233 | 10,110.00 | 5,919,405,000 | 1.65 |
| 日本 | 株式 | リクルートホールディングス | サービス業 | 743,900 | 10,603.01 | 7,887,581,189 | 7,657.00 | 5,696,042,300 | 1.59 |
| 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 92,800 | 65,211.92 | 6,051,665,755 | 58,480.00 | 5,426,944,000 | 1.52 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 891,800 | 5,702.34 | 5,085,350,480 | 5,736.00 | 5,115,364,800 | 1.43 |
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 1,233,000 | 3,891.56 | 4,798,298,220 | 4,051.00 | 4,994,883,000 | 1.39 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 1,813,400 | 2,566.50 | 4,654,088,036 | 2,626.50 | 4,762,895,100 | 1.33 |
| 日本 | 株式 | 伊藤忠商事 | 卸売業 | 659,600 | 7,495.76 | 4,944,200,147 | 6,901.00 | 4,551,899,600 | 1.27 |
| 日本 | 株式 | 三菱重工業 | 機械 | 1,637,500 | 2,248.45 | 3,681,839,964 | 2,526.00 | 4,136,325,000 | 1.15 |
| 日本 | 株式 | 三井物産 | 卸売業 | 1,441,400 | 3,192.42 | 4,601,557,616 | 2,799.50 | 4,035,199,300 | 1.13 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 27,603,100 | 155.11 | 4,281,596,642 | 144.70 | 3,994,168,570 | 1.12 |
| 日本 | 株式 | 東京エレクトロン | 電気機器 | 196,300 | 23,653.18 | 4,643,118,650 | 20,110.00 | 3,947,593,000 | 1.10 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 828,200 | 4,125.58 | 3,416,803,684 | 4,413.00 | 3,654,846,600 | 1.02 |
| 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 826,100 | 5,523.39 | 4,562,875,265 | 4,236.00 | 3,499,359,600 | 0.98 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 458,000 | 8,907.34 | 4,079,563,834 | 7,479.00 | 3,425,382,000 | 0.96 |
| 日本 | 株式 | ＫＤＤＩ | 情報・通信業 | 1,364,000 | 2,479.77 | 3,382,400,133 | 2,359.50 | 3,218,358,000 | 0.90 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンク | 情報・通信業 | 14,854,600 | 195.35 | 2,901,791,899 | 208.40 | 3,095,698,640 | 0.86 |
| 日本 | 株式 | 第一三共 | 医薬品 | 860,900 | 4,846.96 | 4,172,743,596 | 3,511.00 | 3,022,619,900 | 0.84 |
| 日本 | 株式 | ＨＯＹＡ | 精密機器 | 179,900 | 19,539.56 | 3,515,166,391 | 16,780.00 | 3,018,722,000 | 0.84 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 2,198,200 | 1,308.63 | 2,876,626,951 | 1,342.50 | 2,951,083,500 | 0.82 |
| 日本 | 株式 | 三菱電機 | 電気機器 | 953,300 | 2,572.12 | 2,451,998,015 | 2,720.00 | 2,592,976,000 | 0.72 |

| | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 株式 | 富士通 | 電気機器 | 861,900 | 2,865.40 | 2,469,684,873 | 2,951.00 | 2,543,466,900 | 0.71 |
| 日本 | 株式 | ファーストリテイリング | 小売業 | 55,200 | 50,413.12 | 2,782,803,975 | 44,060.00 | 2,432,112,000 | 0.68 |
| 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業 | 1,084,700 | 2,594.86 | 2,814,645,615 | 2,163.00 | 2,346,206,100 | 0.66 |
| 日本 | 株式 | 日本たばこ産業 | 食料品 | 554,900 | 4,212.51 | 2,337,524,403 | 4,114.00 | 2,282,858,600 | 0.64 |
| 日本 | 株式 | ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス | 保険業 | 669,200 | 3,433.16 | 2,297,467,922 | 3,225.00 | 2,158,170,000 | 0.60 |

ロ　種類別・業種別投資比率

2025年3月31日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率（%） |
|---|---|---|
| 株式（国内） | 水産・農林業 | 0.08 |
| | 鉱業 | 0.27 |
| | 建設業 | 2.16 |
| | 食料品 | 3.04 |
| | 繊維製品 | 0.42 |
| | パルプ・紙 | 0.14 |
| | 化学 | 4.80 |
| | 医薬品 | 4.14 |
| | 石油・石炭製品 | 0.54 |
| | ゴム製品 | 0.64 |
| | ガラス・土石製品 | 0.63 |
| | 鉄鋼 | 0.86 |
| | 非鉄金属 | 0.76 |
| | 金属製品 | 0.49 |
| | 機械 | 5.45 |
| | 電気機器 | 17.06 |
| | 輸送用機器 | 7.08 |
| | 精密機器 | 2.15 |
| | その他製品 | 2.92 |
| | 電気・ガス業 | 1.27 |
| | 陸運業 | 2.36 |
| | 海運業 | 0.66 |
| | 空運業 | 0.35 |
| | 倉庫・運輸関連業 | 0.14 |
| | 情報・通信業 | 7.43 |
| | 卸売業 | 6.59 |
| | 小売業 | 4.43 |
| | 銀行業 | 9.33 |
| | 証券、商品先物取引業 | 0.88 |

| | | |
|---|---|---|
| | 保険業 | 3.45 |
| | その他金融業 | 1.12 |
| | 不動産業 | 1.90 |
| | サービス業 | 4.47 |
| 合　計 | | 98.02 |

外国株式インデックス・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2025年3月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿単価（円） | 帳簿価額（円） | 評価額単価（円） | 評価額（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 株式 | APPLE INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 1,396,982 | 35,451.91 | 49,525,676,752 | 32,580.41 | 45,514,243,528 | 4.99 |
| アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP | 半導体・半導体製造装置 | 2,276,498 | 20,669.65 | 47,054,421,885 | 16,397.86 | 37,329,691,851 | 4.09 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 656,620 | 63,318.91 | 41,576,462,450 | 56,638.18 | 37,189,759,125 | 4.08 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | 一般消費財・サービス流通・小売り | 880,017 | 31,163.56 | 27,424,459,493 | 28,815.49 | 25,358,124,935 | 2.78 |
| アメリカ | 株式 | META PLATFORMS INC-CLASS A | メディア・娯楽 | 202,810 | 86,156.78 | 17,473,457,517 | 86,234.16 | 17,489,150,963 | 1.92 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | メディア・娯楽 | 542,910 | 25,338.39 | 13,756,463,290 | 23,075.42 | 12,527,877,140 | 1.37 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C | メディア・娯楽 | 461,454 | 25,567.58 | 11,798,260,703 | 23,334.09 | 10,767,609,720 | 1.18 |
| アメリカ | 株式 | TESLA INC | 自動車・自動車部品 | 269,036 | 51,633.64 | 13,891,307,332 | 39,406.00 | 10,601,631,539 | 1.16 |
| アメリカ | 株式 | BROADCOM INC | 半導体・半 | 414,560 | 24,525.03 | 10,167,097,728 | 25,286.82 | 10,482,905,094 | 1.15 |

| | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 導体製造装置 | | | | | | |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 金融サービス | 123,633 | 72,237.24 | 8,930,906,873 | 78,693.87 | 9,729,159,378 | 1.07 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 261,379 | 37,372.32 | 9,768,339,090 | 36,310.93 | 9,490,915,095 | 1.04 |
| アメリカ | 株式 | ELI LILLY & CO | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 74,961 | 118,986.20 | 8,919,324,794 | 122,981.70 | 9,218,830,853 | 1.01 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | 金融サービス | 161,196 | 47,466.57 | 7,651,421,681 | 51,262.93 | 8,263,379,586 | 0.91 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP | エネルギー | 408,498 | 17,615.74 | 7,195,992,924 | 17,602.99 | 7,190,786,045 | 0.79 |
| アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC | ヘルスケア機器・サービス | 85,492 | 90,868.11 | 7,768,496,771 | 77,158.30 | 6,596,417,451 | 0.72 |
| アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC - A | 金融サービス | 75,943 | 79,666.43 | 6,050,107,829 | 80,832.01 | 6,138,625,122 | 0.67 |
| アメリカ | 株式 | COSTCO WHOLESALE CORP | 生活必需品流通・小売り | 41,237 | 145,419.81 | 5,996,676,645 | 139,002.76 | 5,732,056,946 | 0.63 |
| アメリカ | 株式 | NETFLIX INC | メディア・娯楽 | 39,901 | 132,956.74 | 5,305,106,983 | 139,629.25 | 5,571,346,784 | 0.61 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | 家庭用品・パーソナル用品 | 219,881 | 26,751.77 | 5,882,206,689 | 25,123.85 | 5,524,256,294 | 0.61 |
| アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 223,662 | 23,163.90 | 5,180,883,533 | 24,477.92 | 5,474,780,364 | 0.60 |
| アメリカ | 株式 | WALMART INC | 生活必需品流通・小売り | 412,421 | 13,844.41 | 5,709,726,032 | 12,731.63 | 5,250,790,751 | 0.58 |
| アメリカ | 株式 | ABBVIE INC | 医薬品・バ | 165,094 | 27,367.14 | 4,518,150,276 | 30,694.96 | 5,067,553,858 | 0.56 |

| | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | イオテクノロジー・ライフサイエンス | | | | | | |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC | 一般消費財・サービス流通・小売り | 92,765 | 64,038.74 | 5,940,554,087 | 53,550.59 | 4,967,620,295 | 0.54 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO/THE | 食品・飲料・タバコ | 378,121 | 9,572.58 | 3,619,591,856 | 10,521.72 | 3,978,484,195 | 0.44 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | エネルギー | 159,365 | 24,191.43 | 3,855,267,132 | 24,833.78 | 3,957,634,839 | 0.43 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 銀行 | 640,301 | 7,099.17 | 4,545,604,077 | 6,167.70 | 3,949,184,477 | 0.43 |
| ドイツ | 株式 | SAP SE | ソフトウェア・サービス | 97,006 | 36,647.88 | 3,555,064,280 | 39,993.24 | 3,879,584,239 | 0.43 |
| オランダ | 株式 | ASML HOLDING NV | 半導体・半導体製造装置 | 36,764 | 106,941.03 | 3,931,580,176 | 101,397.25 | 3,727,768,425 | 0.41 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA-REG | 食品・飲料・タバコ | 242,311 | 12,996.85 | 3,149,278,517 | 15,344.41 | 3,718,119,234 | 0.41 |
| アメリカ | 株式 | SALESFORCE INC | ソフトウェア・サービス | 88,160 | 49,347.25 | 4,350,453,936 | 40,365.91 | 3,558,659,013 | 0.39 |

ロ　種類別・業種別投資比率

2025年3月31日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率（%） |
|---|---|---|
| 株式（外国） | エネルギー | 4.20 |
| | 素材 | 3.31 |
| | 資本財 | 7.16 |
| | 商業・専門サービス | 1.60 |
| | 運輸 | 1.42 |
| | 自動車・自動車部品 | 1.70 |
| | 耐久消費財・アパレル | 1.10 |
| | 消費者サービス | 1.94 |
| | 一般消費財・サービス流通・小売り | 4.85 |

| | | |
|---|---|---|
| | 生活必需品流通・小売り | 1.81 |
| | 食品・飲料・タバコ | 3.07 |
| | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.46 |
| | ヘルスケア機器・サービス | 3.99 |
| | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.09 |
| | 銀行 | 6.10 |
| | 金融サービス | 7.45 |
| | 保険 | 3.40 |
| | ソフトウェア・サービス | 9.48 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 6.45 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 7.81 |
| | 電気通信サービス | 1.33 |
| | 公益事業 | 2.71 |
| | メディア・娯楽 | 6.43 |
| | 不動産管理・開発 | 0.28 |
| 新株予約権証券 | － | 0.00 |
| 投資証券 | － | 1.91 |
| 合　計 | | 98.03 |

エマージング株式インデックス・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2025年3月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿単価（円） | 帳簿価額（円） | 評価額単価（円） | 評価額（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 台湾 | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・半導体製造装置 | 1,121,000 | 4,495.22 | 5,039,136,876 | 4,295.04 | 4,814,743,427 | 8.30 |
| ケイマン諸島 | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD | メディア・娯楽 | 294,100 | 7,723.37 | 2,271,441,768 | 9,792.59 | 2,880,000,719 | 4.96 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | － | 351,837 | 6,138.55 | 2,159,767,948 | 6,140.79 | 2,160,555,864 | 3.72 |
| 香港 | 投資信託受益証券 | CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY | － | 2,595,200 | 832.2361 | 2,159,819,127 | 829.6404 | 2,153,082,890 | 3.71 |
| ケイマン諸島 | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 一般消費財・サービス流通・小売り | 736,900 | 1,646.35 | 1,213,196,041 | 2,517.82 | 1,855,381,558 | 3.20 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | テクノロジー・ハードウェアおよび | 217,724 | 5,514.70 | 1,200,682,245 | 6,122.34 | 1,332,980,354 | 2.30 |

| | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 機器 | | | | | | |
| インド | 株式 | HDFC BANK LIMITED | 銀行 | 258,404 | 3,153.93 | 814,988,015 | 3,217.63 | 831,448,979 | 1.43 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI UAE ETF | － | 304,937 | 2,359.21 | 719,411,918 | 2,519.41 | 768,261,937 | 1.32 |
| ケイマン諸島 | 株式 | XIAOMI CORP-CLASS B | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 749,200 | 588.50 | 440,901,654 | 981.18 | 735,100,805 | 1.27 |
| ケイマン諸島 | 株式 | MEITUAN-CLASS B | 消費者サービス | 224,660 | 3,236.42 | 727,094,133 | 3,077.12 | 691,306,228 | 1.19 |
| インド | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LTD | エネルギー | 278,338 | 2,267.29 | 631,073,480 | 2,244.18 | 624,639,459 | 1.08 |
| ケイマン諸島 | 株式 | PDD HOLDINGS INC | 一般消費財・サービス流通・小売り | 31,603 | 14,573.56 | 460,568,298 | 18,009.68 | 569,160,043 | 0.98 |
| インド | 株式 | ICICI BANK LTD | 銀行 | 238,953 | 2,280.16 | 544,850,123 | 2,373.10 | 567,058,408 | 0.98 |
| 中国 | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 銀行 | 4,375,000 | 113.21 | 495,272,996 | 128.77 | 563,386,250 | 0.97 |
| 韓国 | 株式 | SK HYNIX INC | 半導体・半導体製造装置 | 24,970 | 16,426.04 | 410,158,134 | 20,268.81 | 506,112,185 | 0.87 |
| 台湾 | 株式 | MEDIATEK INC | 半導体・半導体製造装置 | 70,000 | 5,723.79 | 400,665,631 | 6,609.49 | 462,664,580 | 0.80 |
| 中国 | 株式 | BYD CO LTD-H | 自動車・自動車部品 | 55,500 | 5,326.27 | 295,607,745 | 7,818.70 | 433,937,628 | 0.75 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI KUWAIT ETF | － | 81,017 | 4,912.14 | 397,966,836 | 5,318.28 | 430,870,837 | 0.74 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI QATAR ETF | － | 159,738 | 2,720.43 | 434,556,112 | 2,653.98 | 423,941,457 | 0.73 |
| インド | 株式 | INFOSYS LTD | ソフトウェア・サービス | 152,013 | 3,253.89 | 494,633,205 | 2,764.34 | 420,216,224 | 0.72 |
| 台湾 | 株式 | HON HAI PRECISION INDUSTRY | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 571,800 | 875.85 | 500,812,161 | 694.79 | 397,278,863 | 0.68 |
| インド | 株式 | BHARTI AIRTEL LTD | 電気通信サービス | 117,572 | 2,862.79 | 336,583,666 | 3,050.78 | 358,686,776 | 0.62 |
| ケイマン諸島 | 株式 | JD.COM INC-CLASS A | 一般消費財・サービス流通・小売 | 111,785 | 2,776.83 | 310,408,149 | 3,159.77 | 353,214,665 | 0.61 |

| | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | り | | | | | | |
| 中国 | 株式 | IND & COMM BK OF CHINA-H | 銀行 | 3,159,000 | 88.61 | 279,918,092 | 105.52 | 333,330,730 | 0.57 |
| 南アフリカ | 株式 | NASPERS LTD-N SHS | 一般消費財・サービス流通・小売り | 7,787 | 33,209.63 | 258,603,372 | 37,316.79 | 290,585,814 | 0.50 |
| 中国 | 株式 | BANK OF CHINA LTD-H | 銀行 | 3,233,000 | 70.03 | 226,404,549 | 88.22 | 285,214,613 | 0.49 |
| 中国 | 株式 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 保険 | 305,000 | 862.38 | 263,026,401 | 902.38 | 275,225,595 | 0.47 |
| ケイマン諸島 | 株式 | TRIP.COM GROUP LTD | 消費者サービス | 28,150 | 9,713.34 | 273,430,577 | 9,744.54 | 274,308,801 | 0.47 |
| ケイマン諸島 | 株式 | NETEASE INC | メディア・娯楽 | 88,900 | 2,604.01 | 231,496,322 | 3,029.07 | 269,284,500 | 0.46 |
| インド | 株式 | TATA CONSULTANCY SVCS LTD | ソフトウェア・サービス | 41,587 | 7,442.10 | 309,494,658 | 6,346.82 | 263,945,369 | 0.45 |

ロ　種類別・業種別投資比率

2025年3月31日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率（%） |
|---|---|---|
| 株式（外国） | エネルギー | 3.40 |
| | 素材 | 4.44 |
| | 資本財 | 3.69 |
| | 商業・専門サービス | 0.02 |
| | 運輸 | 1.51 |
| | 自動車・自動車部品 | 3.47 |
| | 耐久消費財・アパレル | 1.03 |
| | 消費者サービス | 2.68 |
| | 一般消費財・サービス流通・小売り | 6.12 |
| | 生活必需品流通・小売り | 1.05 |
| | 食品・飲料・タバコ | 2.00 |
| | 家庭用品・パーソナル用品 | 0.54 |
| | ヘルスケア機器・サービス | 0.54 |
| | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2.24 |
| | 銀行 | 13.21 |
| | 金融サービス | 2.34 |
| | 保険 | 2.61 |
| | ソフトウェア・サービス | 1.96 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 7.18 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 10.96 |

| | | |
|---|---|---|
| | 電気通信サービス | 1.99 |
| | 公益事業 | 2.02 |
| | メディア・娯楽 | 6.98 |
| | 不動産管理・開発 | 0.94 |
| 投資信託受益証券 | － | 3.71 |
| 投資証券 | － | 7.10 |
| 合　計 | | 93.75 |

Ｊリート・インデックス・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位 30 銘柄）

2025 年 3 月 31 日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価（円） | 帳簿価額（円） | 評価額単価（円） | 評価額（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 | 12,122 | 122,650.34 | 1,486,767,433 | 127,400.00 | 1,544,342,800 | 7.49 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 10,671 | 109,316.90 | 1,166,520,621 | 107,300.00 | 1,144,998,300 | 5.55 |
| 日本 | 投資証券 | 日本都市ファンド投資法人 | 10,779 | 93,974.53 | 1,012,951,509 | 95,700.00 | 1,031,550,300 | 5.00 |
| 日本 | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 6,619 | 142,840.53 | 945,461,463 | 142,500.00 | 943,207,500 | 4.57 |
| 日本 | 投資証券 | ＫＤＸ不動産投資法人 | 5,816 | 149,743.51 | 870,908,273 | 147,800.00 | 859,604,800 | 4.17 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 | 3,621 | 229,284.70 | 830,239,906 | 231,600.00 | 838,623,600 | 4.07 |
| 日本 | 投資証券 | ＧＬＰ投資法人 | 6,852 | 123,744.44 | 847,896,905 | 120,600.00 | 826,351,200 | 4.01 |
| 日本 | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人 | 3,100 | 241,946.95 | 750,035,545 | 236,800.00 | 734,080,000 | 3.56 |
| 日本 | 投資証券 | オリックス不動産投資法人 | 4,144 | 174,209.68 | 721,924,902 | 176,200.00 | 730,172,800 | 3.54 |
| 日本 | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人 | 11,458 | 64,354.45 | 737,373,330 | 63,000.00 | 721,854,000 | 3.50 |
| 日本 | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 4,592 | 148,733.78 | 682,985,517 | 148,600.00 | 682,371,200 | 3.31 |
| 日本 | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人 | 4,087 | 144,699.40 | 591,386,460 | 143,100.00 | 584,849,700 | 2.83 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 7,641 | 68,442.34 | 522,967,919 | 72,500.00 | 553,972,500 | 2.69 |
| 日本 | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人 | 6,254 | 77,736.48 | 486,163,923 | 79,700.00 | 498,443,800 | 2.42 |
| 日本 | 投資証 | 日本プライムリ | 1,421 | 352,127.10 | 500,372,603 | 340,000.00 | 483,140,000 | 2.34 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 券 | アルティ投資法人 | | | | | | |
| 日本 | 投資証券 | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 4,537 | 102,705.61 | 465,975,333 | 102,900.00 | 466,857,300 | 2.26 |
| 日本 | 投資証券 | 産業ファンド投資法人 | 3,811 | 117,274.42 | 446,932,831 | 116,200.00 | 442,838,200 | 2.15 |
| 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 3,586 | 114,355.07 | 410,077,295 | 108,900.00 | 390,515,400 | 1.89 |
| 日本 | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 4,151 | 89,187.93 | 370,219,107 | 92,100.00 | 382,307,100 | 1.85 |
| 日本 | 投資証券 | ラサールロジポート投資法人 | 2,614 | 141,429.73 | 369,697,320 | 139,300.00 | 364,130,200 | 1.77 |
| 日本 | 投資証券 | アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 1,011 | 337,485.32 | 341,197,663 | 340,000.00 | 343,740,000 | 1.67 |
| 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人 | 2,450 | 130,461.01 | 319,629,470 | 134,000.00 | 328,300,000 | 1.59 |
| 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人 | 2,528 | 124,777.71 | 315,438,042 | 123,800.00 | 312,966,400 | 1.52 |
| 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人 | 3,854 | 78,805.45 | 303,716,205 | 79,100.00 | 304,851,400 | 1.48 |
| 日本 | 投資証券 | ＮＴＴ都市開発リート投資法人 | 2,116 | 132,135.98 | 279,599,742 | 132,800.00 | 281,004,800 | 1.36 |
| 日本 | 投資証券 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 1,054 | 268,950.34 | 283,473,654 | 264,100.00 | 278,361,400 | 1.35 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券リビング投資法人 | 3,063 | 88,942.91 | 272,432,143 | 88,700.00 | 271,688,100 | 1.32 |
| 日本 | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人 | 1,841 | 144,232.52 | 265,532,063 | 143,300.00 | 263,815,300 | 1.28 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券オフィス投資法人 | 854 | 291,879.50 | 249,265,095 | 294,900.00 | 251,844,600 | 1.22 |
| 日本 | 投資証券 | 森トラストリート投資法人 | 4,016 | 62,948.69 | 252,801,943 | 62,300.00 | 250,196,800 | 1.21 |

ロ　種類別投資比率

2025年3月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 投資証券 | 98.59 |
| 合　計 | 98.59 |

外国リート・インデックス・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2025年3月31日現在

| 国／ | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 | 帳簿価額 | 評価額 | 評価額 | 投資 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|

| 地域 | | | | (円) | (円) | 単価 (円) | (円) | 比率 (%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC | 189,972 | 18,028.54 | 3,424,917,104 | 16,514.48 | 3,137,289,554 | 7.01 |
| アメリカ | 投資証券 | WELLTOWER INC | 124,872 | 22,498.99 | 2,809,493,586 | 22,939.36 | 2,864,483,562 | 6.40 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUINIX INC | 19,986 | 135,673.12 | 2,711,562,927 | 120,064.56 | 2,399,610,296 | 5.36 |
| アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 63,222 | 27,550.10 | 1,741,772,125 | 24,563.15 | 1,552,931,191 | 3.47 |
| アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORP | 178,339 | 8,568.99 | 1,528,185,321 | 8,464.33 | 1,509,519,648 | 3.37 |
| アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE | 32,120 | 45,356.89 | 1,456,863,371 | 44,014.20 | 1,413,736,181 | 3.16 |
| アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 64,858 | 23,840.45 | 1,546,244,215 | 21,246.79 | 1,378,024,435 | 3.08 |
| オーストラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP | 417,143 | 3,107.72 | 1,296,363,359 | 2,752.38 | 1,148,136,592 | 2.56 |
| アメリカ | 投資証券 | VICI PROPERTIES INC | 216,066 | 4,776.64 | 1,032,068,570 | 4,786.14 | 1,034,121,088 | 2.31 |
| アメリカ | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC | 43,851 | 23,737.84 | 1,040,927,833 | 21,749.18 | 953,723,257 | 2.13 |
| アメリカ | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 29,401 | 33,003.01 | 970,321,384 | 31,934.48 | 938,905,693 | 2.10 |
| アメリカ | 投資証券 | VENTAS INC | 90,208 | 10,125.34 | 913,386,354 | 10,281.00 | 927,428,015 | 2.07 |
| アメリカ | 投資証券 | IRON MOUNTAIN INC | 60,885 | 13,658.21 | 831,580,410 | 12,724.15 | 774,709,994 | 1.73 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL | 70,899 | 10,787.10 | 764,794,894 | 10,672.74 | 756,686,423 | 1.69 |
| アメリカ | 投資証券 | INVITATION HOMES INC | 117,291 | 4,751.75 | 557,336,993 | 5,153.95 | 604,512,465 | 1.35 |
| アメリカ | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 24,067 | 24,349.33 | 586,015,373 | 24,805.37 | 596,990,791 | 1.33 |
| アメリカ | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 13,017 | 44,627.23 | 580,912,710 | 45,753.12 | 595,568,363 | 1.33 |
| アメリカ | 投資証券 | SUN COMMUNITIES INC | 24,368 | 20,073.06 | 489,140,326 | 19,474.98 | 474,566,312 | 1.06 |
| アメリカ | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 31,688 | 14,530.35 | 460,437,844 | 14,294.11 | 452,951,821 | 1.01 |
| アメリカ | 投資証券 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 143,385 | 2,965.93 | 425,270,500 | 3,018.81 | 432,851,899 | 0.97 |
| アメリカ | 投資証券 | KIMCO REALTY CORP | 137,817 | 3,258.04 | 449,013,408 | 3,129.45 | 431,291,906 | 0.96 |
| アメリカ | 投資証券 | WP CAREY INC | 45,683 | 9,369.99 | 428,049,472 | 9,374.90 | 428,273,739 | 0.96 |
| アメリカ | 投資証券 | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 56,240 | 7,309.53 | 411,088,100 | 7,535.81 | 423,813,841 | 0.95 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 投資証券 | CAMDEN PROPERTY TRUST | 22,363 | 18,104.86 | 404,878,950 | 18,286.30 | 408,936,437 | 0.91 |
| アメリカ | 投資証券 | UDR INC | 61,243 | 6,457.77 | 395,493,134 | 6,659.62 | 407,855,156 | 0.91 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 38,978 | 10,020.83 | 390,591,927 | 9,932.61 | 387,153,412 | 0.86 |
| イギリス | 投資証券 | SEGRO PLC | 279,114 | 1,363.72 | 380,632,651 | 1,349.76 | 376,737,603 | 0.84 |
| 香港 | 投資証券 | LINK REIT | 526,300 | 677.51 | 356,570,881 | 702.49 | 369,721,013 | 0.83 |
| アメリカ | 投資証券 | AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 65,376 | 5,200.31 | 339,975,178 | 5,618.96 | 367,345,233 | 0.82 |
| アメリカ | 投資証券 | REGENCY CENTERS CORP | 33,456 | 11,099.92 | 371,358,881 | 10,895.52 | 364,520,597 | 0.81 |

ロ　種類別投資比率

2025年3月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 投資証券 | 98.67 |
| 合　計 | 98.67 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2025年3月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価（円） | 帳簿価額（円） | 評価額単価（円） | 評価額（円） | 利率（%） | 償還期限 | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 国債証券 | １５０　５年国債 | 2,390,000,000 | 99.03 | 2,366,817,000 | 98.65 | 2,357,735,000 | 0.005 | 2026/12/20 | 1.85 |
| 日本 | 国債証券 | １５６　５年国債 | 1,290,000,000 | 98.99 | 1,276,990,800 | 98.23 | 1,267,192,800 | 0.200 | 2027/12/20 | 0.99 |
| 日本 | 国債証券 | １５４　５年国債 | 1,220,000,000 | 98.91 | 1,206,641,000 | 98.16 | 1,197,552,000 | 0.100 | 2027/09/20 | 0.94 |
| 日本 | 国債証券 | ３７５　１０年国債 | 1,220,000,000 | 102.07 | 1,245,254,000 | 97.27 | 1,186,718,400 | 1.100 | 2034/06/20 | 0.93 |
| 日本 | 国債証券 | ３６８　１０年国債 | 1,270,000,000 | 95.18 | 1,208,803,000 | 92.60 | 1,176,058,100 | 0.200 | 2032/09/20 | 0.92 |
| 日本 | 国債証券 | ３６７　１０年国債 | 1,190,000,000 | 95.11 | 1,131,788,900 | 93.02 | 1,106,890,400 | 0.200 | 2032/06/20 | 0.87 |
| 日本 | 国債証券 | ３６９　１０年国債 | 1,170,000,000 | 96.49 | 1,128,896,000 | 94.42 | 1,104,714,000 | 0.500 | 2032/12/20 | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | ３６６　１０年国債 | 1,170,000,000 | 95.48 | 1,117,159,600 | 93.36 | 1,092,312,000 | 0.200 | 2032/03/20 | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | ３７０　１０年国債 | 1,160,000,000 | 96.35 | 1,117,674,800 | 94.09 | 1,091,420,800 | 0.500 | 2033/03/20 | 0.85 |
| 日本 | 国債証券 | ３７６　１０年国債 | 1,090,000,000 | 98.74 | 1,076,240,700 | 95.22 | 1,037,908,900 | 0.900 | 2034/09/20 | 0.81 |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 国債証券 | ３６１　１０年国債 | 1,070,000,000 | 96.34 | 1,030,838,000 | 94.29 | 1,008,881,600 | 0.100 | 2030/12/20 | 0.79 |
| 日本 | 国債証券 | ４６８　２年国債 | 1,010,000,000 | 99.95 | 1,009,495,000 | 99.64 | 1,006,323,600 | 0.600 | 2027/01/01 | 0.79 |
| 日本 | 国債証券 | ３６４　１０年国債 | 1,060,000,000 | 95.34 | 1,010,639,000 | 93.39 | 989,976,400 | 0.100 | 2031/09/20 | 0.78 |
| 日本 | 国債証券 | ３６５　１０年国債 | 1,060,000,000 | 94.94 | 1,006,343,200 | 93.04 | 986,255,800 | 0.100 | 2031/12/20 | 0.77 |
| 日本 | 国債証券 | ３７７　１０年国債 | 1,000,000,000 | 98.59 | 985,872,300 | 97.58 | 975,790,000 | 1.200 | 2034/12/20 | 0.76 |
| 日本 | 国債証券 | ３６３　１０年国債 | 1,040,000,000 | 95.59 | 994,144,300 | 93.72 | 974,636,000 | 0.100 | 2031/06/20 | 0.76 |
| 日本 | 国債証券 | ３７２　１０年国債 | 1,010,000,000 | 98.61 | 995,973,600 | 95.75 | 967,034,600 | 0.800 | 2033/09/20 | 0.76 |
| 日本 | 国債証券 | ３７４　１０年国債 | 1,000,000,000 | 97.71 | 977,141,600 | 95.07 | 950,680,000 | 0.800 | 2034/03/20 | 0.74 |
| 日本 | 国債証券 | ３７１　１０年国債 | 1,020,000,000 | 95.52 | 974,304,000 | 92.94 | 947,957,400 | 0.400 | 2033/06/20 | 0.74 |
| 日本 | 国債証券 | ３６２　１０年国債 | 950,000,000 | 95.84 | 910,479,200 | 94.01 | 893,047,500 | 0.100 | 2031/03/20 | 0.70 |
| 日本 | 国債証券 | ３６０　１０年国債 | 940,000,000 | 96.43 | 906,473,700 | 94.60 | 889,193,000 | 0.100 | 2030/09/20 | 0.70 |
| 日本 | 国債証券 | ３５７　１０年国債 | 910,000,000 | 97.31 | 885,521,000 | 95.47 | 868,767,900 | 0.100 | 2029/12/20 | 0.68 |
| 日本 | 国債証券 | ３５９　１０年国債 | 910,000,000 | 96.56 | 878,665,800 | 94.90 | 863,590,000 | 0.100 | 2030/06/20 | 0.68 |
| 日本 | 国債証券 | ３７３　１０年国債 | 920,000,000 | 96.43 | 887,119,600 | 93.78 | 862,794,400 | 0.600 | 2033/12/20 | 0.68 |
| 日本 | 国債証券 | １５８　５年国債 | 880,000,000 | 98.59 | 867,595,000 | 97.72 | 859,900,800 | 0.100 | 2028/03/20 | 0.67 |
| 日本 | 国債証券 | １４７　２０年国債 | 840,000,000 | 105.61 | 887,090,400 | 101.99 | 856,716,000 | 1.600 | 2033/12/20 | 0.67 |
| 日本 | 国債証券 | ３５８　１０年国債 | 870,000,000 | 97.00 | 843,941,600 | 95.18 | 828,048,600 | 0.100 | 2030/03/20 | 0.65 |
| 日本 | 国債証券 | １７４　５年国債 | 810,000,000 | 99.85 | 808,811,700 | 98.38 | 796,869,900 | 0.700 | 2029/09/20 | 0.62 |
| 日本 | 国債証券 | １５３　５年国債 | 800,000,000 | 98.76 | 790,072,000 | 98.18 | 785,440,000 | 0.005 | 2027/06/20 | 0.61 |
| 日本 | 国債証券 | １５２　５年国債 | 730,000,000 | 99.17 | 723,911,800 | 98.61 | 719,823,800 | 0.100 | 2027/03/20 | 0.56 |

ロ　種類別投資比率

2025年3月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 国債証券 | 77.36 |
| 地方債証券 | 8.23 |
| 特殊債券 | 7.77 |
| 社債券 | 6.09 |

| 合　計 | 99.45 |
|---|---|

外国債券パッシブ・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2025年3月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価（円） | 帳簿価額（円） | 評価額単価（円） | 評価額（円） | 利率（%） | 償還期限 | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 11,450,000 | 14,416.27 | 1,650,662,896 | 14,558.31 | 1,666,926,934 | 1.625 | 2026/05/15 | 0.83 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 72,000,000 | 2,103.01 | 1,514,167,892 | 2,084.43 | 1,500,789,940 | 2.390 | 2026/11/15 | 0.75 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 68,600,000 | 2,094.08 | 1,436,539,431 | 2,076.41 | 1,424,414,294 | 2.040 | 2027/02/25 | 0.71 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 44,700,000 | 2,768.45 | 1,237,497,926 | 2,702.09 | 1,207,835,503 | 3.720 | 2051/04/12 | 0.60 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 8,000,000 | 15,062.50 | 1,204,999,622 | 15,078.94 | 1,206,315,398 | 4.875 | 2026/04/30 | 0.60 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 8,200,000 | 14,575.81 | 1,195,216,229 | 14,688.10 | 1,204,423,970 | 2.250 | 2026/03/31 | 0.60 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 50,000,000 | 2,107.00 | 1,053,501,391 | 2,090.03 | 1,045,013,626 | 2.690 | 2026/08/12 | 0.52 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 6,870,000 | 14,346.89 | 985,631,518 | 14,520.93 | 997,588,154 | 3.875 | 2034/08/15 | 0.50 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 6,350,000 | 14,657.53 | 930,753,103 | 14,943.78 | 948,929,801 | 4.250 | 2034/11/15 | 0.47 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 43,500,000 | 2,127.64 | 925,523,797 | 2,103.69 | 915,105,142 | 2.110 | 2034/08/25 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 6,250,000 | 13,323.28 | 832,704,915 | 13,578.81 | 848,675,520 | 1.625 | 2029/08/15 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,600,000 | 14,751.34 | 826,075,272 | 14,936.45 | 836,441,195 | 4.125 | 2032/11/15 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,500,000 | 14,933.31 | 821,332,050 | 15,103.16 | 830,674,059 | 4.375 | 2034/05/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,500,000 | 14,916.86 | 820,427,454 | 15,002.09 | 825,114,906 | 4.125 | 2027/02/15 | 0.41 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 38,000,000 | 2,131.39 | 809,926,610 | 2,108.94 | 801,396,046 | 2.400 | 2028/07/15 | 0.40 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,700,000 | 13,574.17 | 773,727,872 | 13,801.59 | 786,690,807 | 2.875 | 2032/05/15 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,500,000 | 13,916.72 | 765,419,793 | 14,119.62 | 776,579,218 | 3.375 | 2033/05/15 | 0.39 |
| アメ | 国債 | US TREASURY | 5,100,000 | 14,515.70 | 740,300,732 | 14,701.70 | 749,786,879 | 4.000 | 2034/02/15 | 0.37 |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| リカ | 証券 | N/B | | | | | | | | |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,000,000 | 14,844.79 | 742,239,708 | 14,988.48 | 749,424,144 | 4.000 | 2028/02/29 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 4,900,000 | 14,880.08 | 729,123,963 | 14,964.41 | 733,256,097 | 4.000 | 2027/01/15 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 4,800,000 | 15,085.07 | 724,083,494 | 15,262.70 | 732,609,722 | 4.500 | 2033/11/15 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,000,000 | 14,417.47 | 720,873,300 | 14,610.50 | 730,524,816 | 3.875 | 2033/08/15 | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 4,800,000 | 15,052.93 | 722,540,448 | 15,104.96 | 725,038,030 | 4.625 | 2026/11/15 | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,700,000 | 12,439.91 | 709,075,125 | 12,698.58 | 723,819,292 | 1.125 | 2031/02/15 | 0.36 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 35,000,000 | 2,077.95 | 727,282,117 | 2,066.98 | 723,443,589 | 1.990 | 2026/03/15 | 0.36 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 32,400,000 | 2,237.42 | 724,922,786 | 2,213.22 | 717,082,683 | 3.020 | 2031/05/27 | 0.36 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 34,600,000 | 2,089.06 | 722,816,380 | 2,064.97 | 714,477,958 | 1.740 | 2029/10/15 | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,500,000 | 12,721.61 | 699,688,558 | 12,985.06 | 714,178,542 | 1.625 | 2031/05/15 | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,000,000 | 13,851.53 | 692,576,640 | 14,086.88 | 704,343,864 | 2.375 | 2029/03/31 | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 4,800,000 | 14,395.34 | 690,976,177 | 14,551.88 | 698,490,455 | 2.625 | 2027/05/31 | 0.35 |

ロ　種類別投資比率

2025年3月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 国債証券 | 98.54 |
| 合　計 | 98.54 |

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2025年3月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価（円） | 帳簿価額（円） | 評価額単価（円） | 評価額（円） | 利率（%） | 償還期限 | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,900,000 | 14,758.97 | 280,420,423 | 14,787.53 | 280,963,032 | 3.500 | 2028/01/31 | 0.80 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 9,000,000 | 2,145.58 | 193,102,518 | 2,182.50 | 196,424,783 | 2.670 | 2033/05/25 | 0.56 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,300,000 | 15,179.72 | 197,336,346 | 14,701.70 | 191,122,145 | 4.000 | 2034/02/15 | 0.55 |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,260,000 | 15,521.18 | 195,566,889 | 15,103.16 | 190,299,875 | 4.375 | 2034/05/15 | 0.54 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 8,830,000 | 2,081.55 | 183,800,448 | 2,064.97 | 182,336,427 | 1.740 | 2029/10/15 | 0.52 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 8,300,000 | 2,059.73 | 170,957,509 | 2,058.79 | 170,879,759 | 1.620 | 2027/08/15 | 0.49 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 8,300,000 | 2,060.20 | 170,996,456 | 2,052.25 | 170,336,665 | 1.420 | 2027/11/15 | 0.49 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,100,000 | 15,404.60 | 169,450,567 | 15,131.87 | 166,450,598 | 4.750 | 2045/02/15 | 0.48 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 7,800,000 | 2,097.87 | 163,634,067 | 2,095.99 | 163,487,563 | 2.480 | 2027/04/15 | 0.47 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,100,000 | 14,700.11 | 161,701,244 | 14,601.53 | 160,616,776 | 4.500 | 2054/11/15 | 0.46 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 7,300,000 | 2,071.58 | 151,225,346 | 2,081.65 | 151,960,644 | 1.910 | 2029/07/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1,000,000 | 15,196.02 | 151,960,166 | 15,183.16 | 151,831,579 | 4.375 | 2032/01/31 | 0.43 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 7,100,000 | 2,066.51 | 146,722,098 | 2,068.40 | 146,856,503 | 1.850 | 2027/05/15 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 960,000 | 15,760.90 | 151,304,670 | 15,262.70 | 146,521,944 | 4.500 | 2033/11/15 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 900,000 | 15,567.57 | 140,108,164 | 15,328.94 | 137,960,459 | 4.625 | 2029/04/30 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 900,000 | 15,189.71 | 136,707,420 | 15,097.93 | 135,881,383 | 4.625 | 2026/10/15 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 900,000 | 15,169.85 | 136,528,655 | 15,090.61 | 135,815,445 | 4.625 | 2026/09/15 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 900,000 | 14,956.06 | 134,604,511 | 15,084.47 | 135,760,272 | 4.250 | 2028/01/15 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 900,000 | 14,994.61 | 134,951,518 | 14,972.33 | 134,751,012 | 4.125 | 2026/06/15 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 900,000 | 14,788.66 | 133,097,919 | 14,943.78 | 134,493,987 | 4.250 | 2034/11/15 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 980,000 | 13,931.53 | 136,528,954 | 13,639.51 | 133,667,231 | 2.750 | 2032/08/15 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 890,000 | 15,152.51 | 134,857,306 | 14,982.05 | 133,340,276 | 4.000 | 2029/01/31 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 900,000 | 15,021.34 | 135,192,100 | 14,751.05 | 132,759,406 | 3.625 | 2029/08/31 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 970,000 | 13,457.56 | 130,538,337 | 13,680.48 | 132,700,674 | 0.625 | 2027/12/31 | 0.38 |
| フラン | 国債 | FRANCE OAT. | 840,000 | 15,226.36 | 127,901,444 | 15,562.11 | 130,721,734 | 0.000 | 2027/02/25 | 0.37 |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ス | 証券 | | | | | | | | | |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 890,000 | 14,891.75 | 132,536,573 | 14,520.93 | 129,236,311 | 3.875 | 2034/08/15 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 880,000 | 14,454.96 | 127,203,673 | 14,544.56 | 127,992,110 | 1.875 | 2026/07/31 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 840,000 | 15,251.49 | 128,112,476 | 15,177.33 | 127,489,543 | 4.625 | 2027/06/15 | 0.36 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE OAT. | 950,000 | 13,389.31 | 127,198,422 | 13,332.70 | 126,660,657 | 0.000 | 2031/11/25 | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 870,000 | 14,543.29 | 126,526,600 | 14,448.42 | 125,701,224 | 3.125 | 2029/08/31 | 0.36 |

ロ　種類別投資比率

2025年3月31日現在

| 種類 | 投資比率（%） |
|---|---|
| 国債証券 | 99.14 |
| 合　計 | 99.14 |

②投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2025年3月31日現在

| 種類 | 国／地域 | 取引所等 | 名称 | 買建／売建 | 数量 | 通貨 | 簿価（円） | 時価（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | 日本 | 大阪取引所 | ＴＯＰＩＸ先物　０７０６月　２０２５年６月 | 買建 | 256 | 日本・円 | 6,969,246,600 | 6,814,720,000 | 1.90 |

（注）主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

2025年3月31日現在

| 種類 | 国／地域 | 取引所等 | 名称 | 買建／売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額 | 簿価（円） | 評価額 | 時価（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | イギリス | ＩＣＥ－ＥＵ | ＦＴＳＥ１００ＩＤＸＦＵＴＪＵＮ２５ 2025年6月 | 買建 | 44 | イギリス・ポンド | 3,813,788.00 | 739,188,390 | 3,813,040.00 | 739,043,412 | 0.08 |
| | ドイツ | ＥＵＲＥＸ | ＥＵＲＯＳＴＯＸＸ　５０ＪＵＮ２５ 2025年6月 | 買建 | 302 | ユーロ | 16,175,254.00 | 2,621,685,168 | 15,912,380.00 | 2,579,078,550 | 0.28 |
| | アメリカ | シカゴ商品取引所 | Ｓ＆Ｐ５００ＥＭＩＮＩ　ＦＵＴ　ＪＵＮ２５ 2025年6月 | 買建 | 342 | アメリカ・ドル | 97,537,318.50 | 14,583,779,862 | 96,153,300.00 | 14,376,841,416 | 1.58 |
| | オーストラリア | シドニー先物取引所 | ＳＰＩ２００ＦＵＴＵＲＥＳＪＵＮ２５ 2025年6月 | 買建 | 26 | オーストラリア・ドル | 5,182,517.00 | 487,001,122 | 5,213,000.00 | 489,865,610 | 0.05 |

（注）主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2025年3月31日現在

| 種類 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 簿価（円） | 時価（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 為替予約 | アメリカ・ドル | 買建 | 19,573,000.00 | 2,946,123,493 | 2,925,964,312 | 0.32 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 取引 | ユーロ | 買建 | 1,876,000.00 | 305,086,785 | 304,031,709 | 0.03 |
| | カナダ・ドル | 買建 | 1,079,000.00 | 113,769,396 | 112,765,754 | 0.01 |
| | イギリス・ポンド | 買建 | 376,000.00 | 73,519,355 | 72,859,287 | 0.01 |
| | スイス・フラン | 買建 | 425,000.00 | 72,764,760 | 72,268,147 | 0.01 |
| | スウェーデン・クローナ | 買建 | 4,405,000.00 | 66,482,022 | 65,937,123 | 0.01 |

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2025年3月31日現在

| 種類 | 国／地域 | 取引所等 | 名称 | 買建／売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額 | 簿価（円） | 評価額 | 時価（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | ＩＣＥ－ＵＳ | ＭＳＣＩ ＥＭＧＭＫＴ ＪＵＮ２５ 2025年６月 | 買建 | 447 | アメリカ・ドル | 25,751,087.00 | 3,850,302,528 | 24,895,665.00 | 3,722,399,830 | 6.42 |

（注）主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2025年3月31日現在

| 種類 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 簿価（円） | 時価（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | アメリカ・ドル | 買建 | 1,606,449.25 | 241,445,758 | 240,140,067 | 0.41 |
| | マレーシア・リンギット | 売建 | 10,141.90 | 345,758 | 341,693 | △0.00 |

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

Ｊリート・インデックス・マザーファンド

2025年3月31日現在

| 種類 | 国／地域 | 取引所等 | 名称 | 買建／売建 | 数量 | 通貨 | 簿価（円） | 時価（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| リート指数先物取引 | 日本 | 大阪取引所 | ＴＲＥＩＴ先物 ０７０６月 ２０２５年６月 | 買建 | 20 | 日本・円 | 32,788,400 | 33,670,000 | 0.16 |

（注）主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

2025年3月31日現在

| 種類 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 簿価（円） | 時価（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | アメリカ・ドル | 買建 | 460,893.61 | 69,300,000 | 68,896,965 | 0.15 |
| | オーストラリア・ドル | 買建 | 120,868.89 | 11,400,000 | 11,355,830 | 0.03 |
| | イギリス・ポンド | 買建 | 34,067.22 | 6,600,000 | 6,600,592 | 0.01 |
| | ユーロ | 買建 | 35,793.17 | 5,800,000 | 5,800,318 | 0.01 |

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2025年3月31日現在

| 種類 | 資産の名称 | 買建／売建 | 数量 | 簿価（円） | 時価（円） | 投資比率（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | アメリカ・ドル | 買建 | 810,000.00 | 120,160,600 | 121,056,120 | 0.35 |
| | ユーロ | 買建 | 470,000.00 | 75,670,587 | 76,159,411 | 0.22 |
| | オフショア・人民元 | 買建 | 1,070,000.00 | 21,935,487 | 22,008,830 | 0.06 |
| | イギリス・ポンド | 買建 | 70,000.00 | 13,438,726 | 13,561,051 | 0.04 |
| | イスラエル・シュケル | 買建 | 280,000.00 | 11,661,473 | 11,318,720 | 0.03 |
| | メキシコ・ペソ | 買建 | 990,000.00 | 7,264,338 | 7,249,077 | 0.02 |
| | カナダ・ドル | 買建 | 50,000.00 | 5,143,255 | 5,224,600 | 0.01 |
| | オーストラリア・ドル | 買建 | 30,000.00 | 2,800,449 | 2,817,981 | 0.01 |
| | シンガポール・ドル | 買建 | 10,000.00 | 1,111,766 | 1,114,560 | 0.00 |
| | アメリカ・ドル | 売建 | 111,560,000.00 | 16,748,131,376 | 16,672,865,120 | △47.71 |
| | ユーロ | 売建 | 65,460,000.00 | 10,241,478,229 | 10,607,223,498 | △30.35 |
| | オフショア・人民元 | 売建 | 192,360,000.00 | 3,966,227,762 | 3,956,652,840 | △11.32 |
| | イギリス・ポンド | 売建 | 9,740,000.00 | 1,841,939,345 | 1,886,923,382 | △5.40 |
| | カナダ・ドル | 売建 | 6,690,000.00 | 698,144,046 | 699,051,480 | △2.00 |
| | オーストラリア・ドル | 売建 | 4,670,000.00 | 436,167,887 | 438,665,709 | △1.26 |
| | シンガポール・ドル | 売建 | 2,790,000.00 | 311,017,937 | 310,962,240 | △0.89 |
| | メキシコ・ペソ | 売建 | 38,370,000.00 | 279,242,971 | 280,956,651 | △0.80 |
| | ポーランド・ズロチ | 売建 | 5,390,000.00 | 202,382,111 | 208,915,322 | △0.60 |
| | イスラエル・シュケル | 売建 | 3,070,000.00 | 128,104,461 | 124,101,680 | △0.36 |
| | ニュージーランド・ドル | 売建 | 1,170,000.00 | 98,473,772 | 99,719,919 | △0.29 |
| | デンマーク・クローネ | 売建 | 3,570,000.00 | 74,881,196 | 77,526,120 | △0.22 |
| | スウェーデン・クローナ | 売建 | 3,990,000.00 | 55,914,781 | 59,719,527 | △0.17 |
| | ノルウェー・クローネ | 売建 | 3,630,000.00 | 48,471,875 | 51,775,779 | △0.15 |

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

≪参考情報≫

基準日:2025年3月31日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## 基準価額・純資産の推移

## 分配の推移

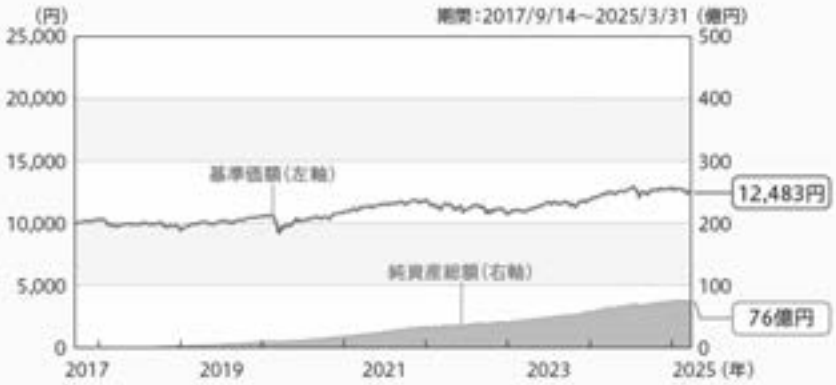
### □1安定重視型

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

| 決算期 | 分配金 |
|---|---|
| 2024年9月 | 0円 |
| 2023年9月 | 0円 |
| 2022年9月 | 0円 |
| 2021年9月 | 0円 |
| 2020年9月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

### □2やや安定型

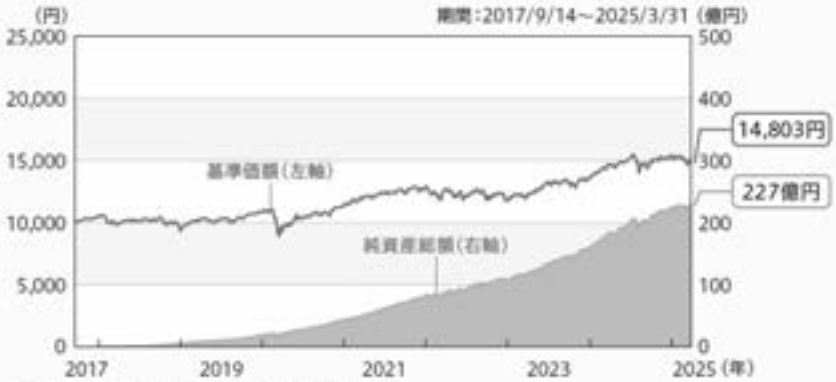



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

| 決算期 | 分配金 |
|---|---|
| 2024年9月 | 0円 |
| 2023年9月 | 0円 |
| 2022年9月 | 0円 |
| 2021年9月 | 0円 |
| 2020年9月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

### □3バランス型

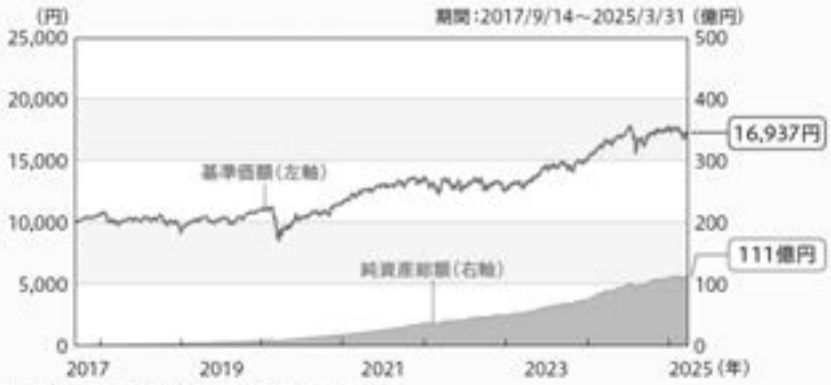



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

| 決算期 | 分配金 |
|---|---|
| 2024年9月 | 0円 |
| 2023年9月 | 0円 |
| 2022年9月 | 0円 |
| 2021年9月 | 0円 |
| 2020年9月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

## □4やや成長型

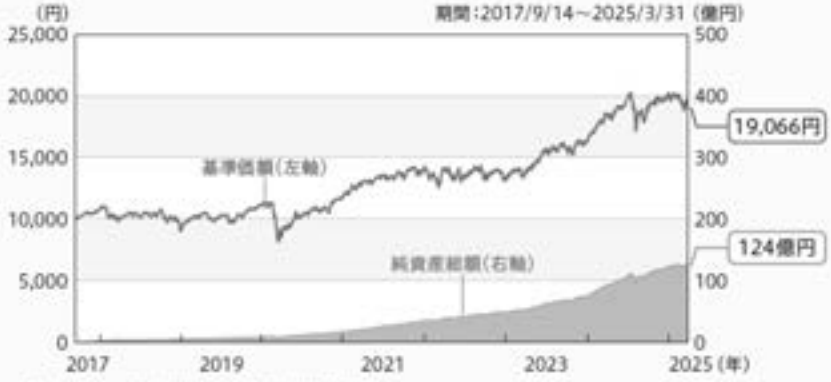



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

| 決算期 | 分配金 |
|---|---|
| 2024年9月 | 0円 |
| 2023年9月 | 0円 |
| 2022年9月 | 0円 |
| 2021年9月 | 0円 |
| 2020年9月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

## □5成長重視型




※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

| 決算期 | 分配金 |
|---|---|
| 2024年9月 | 0円 |
| 2023年9月 | 0円 |
| 2022年9月 | 0円 |
| 2021年9月 | 0円 |
| 2020年9月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

## 主要な資産の状況

### ■1安定重視型

資産別構成

| 資産の種類 | 国・地域 | 比率(%) |
|---|---|---|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 98.26 |
| 投資証券 | アメリカ | 0.86 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 0.88 |
| 合計(純資産総額) | | 100.00 |

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 比率(%) |
|---|---|---|---|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 35.99 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 32.90 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス・マザーファンド | 10.72 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 7.65 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 7.00 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 2.00 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | Jリート・インデックス・マザーファンド | 1.02 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 0.99 |
| アメリカ | 投資証券 | iシェアーズ　J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券ETF | 0.86 |

### ■2やや安定型

資産別構成

| 資産の種類 | 国・地域 | 比率(%) |
|---|---|---|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 97.29 |
| 投資証券 | アメリカ | 1.76 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 0.95 |
| 合計(純資産総額) | | 100.00 |

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 比率(%) |
|---|---|---|---|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 28.05 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 20.02 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス・マザーファンド | 18.51 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 14.69 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 9.03 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 3.01 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | Jリート・インデックス・マザーファンド | 2.06 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 1.91 |
| アメリカ | 投資証券 | iシェアーズ　J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券ETF | 1.76 |

### ■3バランス型

資産別構成

| 資産の種類 | 国・地域 | 比率(%) |
|---|---|---|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 96.47 |
| 投資証券 | アメリカ | 2.63 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 0.90 |
| 合計(純資産総額) | | 100.00 |

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 比率(%) |
|---|---|---|---|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス・マザーファンド | 25.64 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 20.54 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 16.07 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 14.09 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 9.01 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 5.04 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | Jリート・インデックス・マザーファンド | 3.12 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 2.96 |
| アメリカ | 投資証券 | iシェアーズ　J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券ETF | 2.63 |

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。
※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## ■4やや成長型

### 資産別構成

| 資産の種類 | 国・地域 | 比率(%) |
|---|---|---|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 95.45 |
| 投資証券 | アメリカ | 3.60 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 0.95 |
| 合計(純資産総額) | | 100.00 |

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 比率(%) |
|---|---|---|---|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス・マザーファンド | 32.47 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 25.48 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 9.12 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 7.08 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 7.00 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 6.13 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | Jリート・インデックス・マザーファンド | 4.17 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 4.00 |
| アメリカ | 投資証券 | iシェアーズ　J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券ETF | 3.60 |

## ■5成長重視型

### 資産別構成

| 資産の種類 | 国・地域 | 比率(%) |
|---|---|---|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 94.50 |
| 投資証券 | アメリカ | 4.60 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 0.90 |
| 合計(純資産総額) | | 100.00 |

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 比率(%) |
|---|---|---|---|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス・マザーファンド | 43.30 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 29.80 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 10.01 |
| アメリカ | 投資証券 | iシェアーズ　J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券ETF | 4.60 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | Jリート・インデックス・マザーファンド | 3.16 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 3.12 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 2.99 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 1.07 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 1.04 |

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。
※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

■国内債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 利率(%) | 償還期限 | 比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 国債証券 | 150　5年国債 | 0.005 | 2026/12/20 | 1.85 |
| 日本 | 国債証券 | 156　5年国債 | 0.200 | 2027/12/20 | 0.99 |
| 日本 | 国債証券 | 154　5年国債 | 0.100 | 2027/09/20 | 0.94 |
| 日本 | 国債証券 | 375　10年国債 | 1.100 | 2034/06/20 | 0.93 |
| 日本 | 国債証券 | 368　10年国債 | 0.200 | 2032/09/20 | 0.92 |
| 日本 | 国債証券 | 367　10年国債 | 0.200 | 2032/06/20 | 0.87 |
| 日本 | 国債証券 | 369　10年国債 | 0.500 | 2032/12/20 | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | 366　10年国債 | 0.200 | 2032/03/20 | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | 370　10年国債 | 0.500 | 2033/03/20 | 0.85 |
| 日本 | 国債証券 | 376　10年国債 | 0.900 | 2034/09/20 | 0.81 |

■外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 利率(%) | 償還期限 | 比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1.625 | 2026/05/15 | 0.83 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.390 | 2026/11/15 | 0.75 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.040 | 2027/02/25 | 0.71 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.720 | 2051/04/12 | 0.60 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 4.875 | 2026/04/30 | 0.60 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 2.250 | 2026/03/31 | 0.60 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.690 | 2026/08/12 | 0.52 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 3.875 | 2034/08/15 | 0.50 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 4.250 | 2034/11/15 | 0.47 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.110 | 2034/08/25 | 0.46 |

■ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 利率(%) | 償還期限 | 比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 3.500 | 2028/01/31 | 0.80 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.670 | 2033/05/25 | 0.56 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 4.000 | 2034/02/15 | 0.55 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 4.375 | 2034/05/15 | 0.54 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.740 | 2029/10/15 | 0.52 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.620 | 2027/08/15 | 0.49 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.420 | 2027/11/15 | 0.49 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 4.750 | 2045/02/15 | 0.48 |
| 中国 | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.480 | 2027/04/15 | 0.47 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 4.500 | 2054/11/15 | 0.46 |

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

主要投資銘柄（上位10銘柄）

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 3.60 |
| 日本 | 株式 | ソニーグループ | 電気機器 | 3.36 |
| 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 3.29 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 2.30 |
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 2.00 |
| 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 1.65 |
| 日本 | 株式 | リクルートホールディングス | サービス業 | 1.59 |
| 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 1.52 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 1.43 |
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 1.39 |

■外国株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄（上位10銘柄）

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| アメリカ | 株式 | APPLE INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 4.99 |
| アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP | 半導体・半導体製造装置 | 4.09 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 4.08 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | 一般消費財・サービス流通・小売り | 2.78 |
| アメリカ | 株式 | META PLATFORMS INC-CLASS A | メディア・娯楽 | 1.92 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | メディア・娯楽 | 1.37 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C | メディア・娯楽 | 1.18 |
| アメリカ | 株式 | TESLA INC | 自動車・自動車部品 | 1.16 |
| アメリカ | 株式 | BROADCOM INC | 半導体・半導体製造装置 | 1.15 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 金融サービス | 1.07 |

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄（上位10銘柄）

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 比率（%） |
|---|---|---|---|---|
| 台湾 | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・半導体製造装置 | 8.30 |
| ケイマン諸島 | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD | メディア・娯楽 | 4.96 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | — | 3.72 |
| 香港 | 投資信託受益証券 | CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY | — | 3.71 |
| ケイマン諸島 | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 一般消費財・サービス流通・小売り | 3.20 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2.30 |
| インド | 株式 | HDFC BANK LIMITED | 銀行 | 1.43 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI UAE ETF | — | 1.32 |
| ケイマン諸島 | 株式 | XIAOMI CORP-CLASS B | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 1.27 |
| ケイマン諸島 | 株式 | MEITUAN-CLASS B | 消費者サービス | 1.19 |

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■Jリート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 比率(%) |
|---|---|---|---|
| 日本 | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 | 7.49 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 5.55 |
| 日本 | 投資証券 | 日本都市ファンド投資法人 | 5.00 |
| 日本 | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 4.57 |
| 日本 | 投資証券 | KDX不動産投資法人 | 4.17 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 | 4.07 |
| 日本 | 投資証券 | GLP投資法人 | 4.01 |
| 日本 | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人 | 3.56 |
| 日本 | 投資証券 | オリックス不動産投資法人 | 3.54 |
| 日本 | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人 | 3.50 |

■外国リート・インデックス・マザーファンド

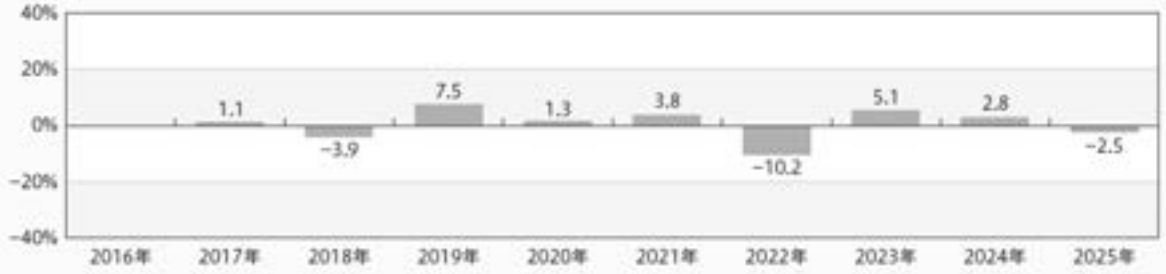
主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 比率(%) |
|---|---|---|---|
| アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC | 7.01 |
| アメリカ | 投資証券 | WELLTOWER INC | 6.40 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUINIX INC | 5.36 |
| アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 3.47 |
| アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORP | 3.37 |
| アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE | 3.16 |
| アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 3.08 |
| オーストラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP | 2.56 |
| アメリカ | 投資証券 | VICI PROPERTIES INC | 2.31 |
| アメリカ | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC | 2.13 |

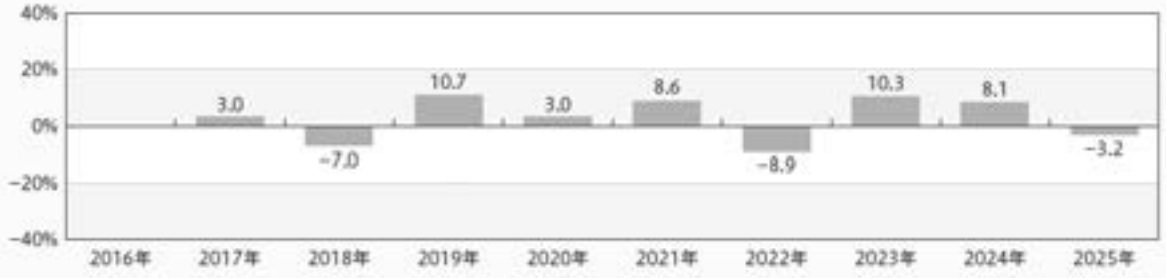
※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## 年間収益率の推移（暦年ベース）

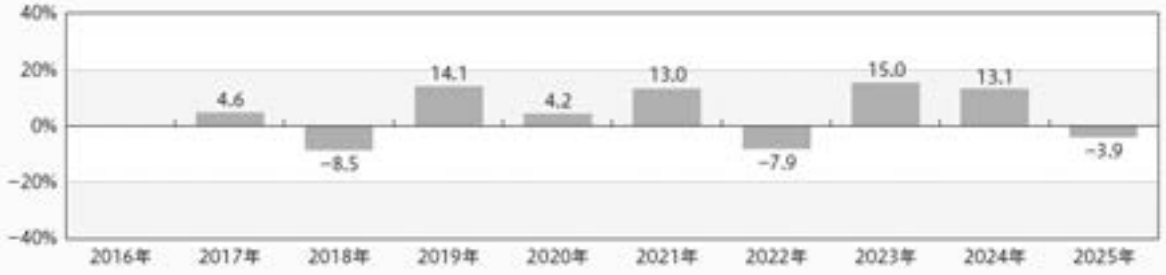
### 1安定重視型




### 2やや安定型

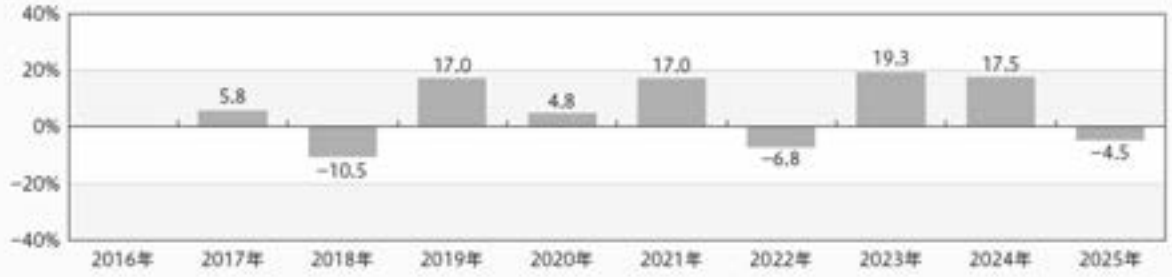



### 3バランス型

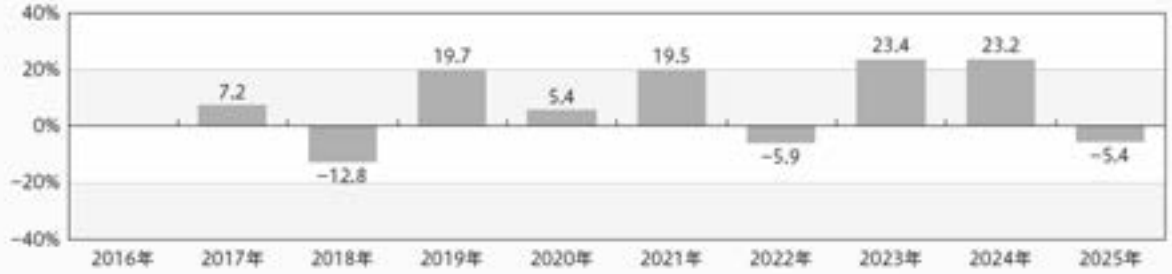



※収益率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。
※ファンドが設定された年の収益率は、設定日から年末までの騰落率です。
※2025年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。
※ファンドにはベンチマークはありません。

□4やや成長型




□5成長重視型




※収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。
※ファンドが設定された年の収益率は、設定日から年末までの騰落率です。
※2025年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。
※ファンドにはベンチマークはありません。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

イ　申込方法

（イ）ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。
当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の２つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。
販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。
お申込みの販売会社にお問い合わせください。

（ロ）原則として午後３時 30 分までに、取得申込みが行われ販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、お申込みの販売会社にご確認ください。
また、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

（ハ）当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。
販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。
ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

（ニ）申込不可日
上記にかかわらず、取得申込日が以下のいずれかに当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。
・ニューヨークの取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日

（ホ）定時定額で取得申込みをする「定時定額購入サービス」（販売会社によっては、名称が異なる場合があります。）を利用する場合は、販売会社との間で「定時定額購入サービス」に関する契約を締結します。詳細については、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ロ　申込価額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。
ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

ハ　申込手数料
ありません。

ニ　申込単位
お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ　照会先
手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

| 照会先の名称 | コールセンター※ | ホームページ |
|---|---|---|
| 三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社 | 0120-88-2976 | https://www.smd-am.co.jp |

※お問い合わせは、午前９時～午後５時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

ヘ　申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト　払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求（一部解約の実行請求）により換金することができます。

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、以下のいずれかに当たる場合には、解約請求の受付けは行いません。

・ニューヨークの取引所の休業日

・ニューヨークの銀行の休業日

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後３時 30 分までに、解約請求のお申込みが行われ販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、お申込みの販売会社にご確認ください。

また、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。

解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して６営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

解約単位の詳細および一部解約価額につきましては、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

イ　基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上１万口単位で表示される場合があります。）。

投資対象とする投資信託証券は、原則として、基準価額計算日に知りうる直近の純資産価格（基準価額）で評価します。また、上場されている場合は、その主たる取引所における最終相場で評価します。

投資対象とする親投資信託受益証券は、当該親投資信託受益証券の基準価額で評価します。

なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値に

よって計算するものとします。また、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<マザーファンドの主要投資対象の評価方法>

| 主要投資対象 | 有価証券等の評価方法 |
|---|---|
| 株式、投資証券、債券等 | (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の最終相場で評価します。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>原則として、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価します。 |
| 市場デリバティブ取引 | 原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の発表する清算値段または最終相場で評価します。 |

※国内で取引される資産については原則として基準価額計算日の値、外国で取引される資産については原則として基準価額計算日に知りうる直近の日の値で評価します。

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊紙面に、「１安定重視型」は「最適安定重視」、「２やや安定型」は「最適やや安定」、「３バランス型」は「最適バランス」、「４やや成長型」は「最適やや成長」、「５成長重視型」は「最適成長重視」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

| 照会先の名称 | コールセンター※ | ホームページ |
|---|---|---|
| 三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社 | 0120-88-2976 | https://www.smd-am.co.jp |

※お問い合わせは、午前９時～午後５時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

（2）【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

（3）【信託期間】

2017 年 9 月 14 日から下記「（5）その他 イ　信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

（4）【計算期間】

毎年 9 月 16 日から翌年 9 月 15 日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

イ　信託の終了

（イ）信託契約の解約

ａ．委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、各ファンドにつき残存口数が 10 億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

ｂ．委託会社は、上記ａの事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

ｃ．書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

ｄ．書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

ｅ．上記ｂ～ｄまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記ｂ～ｄまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

（ロ）信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

（ハ）委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

（ニ）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

ａ．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。

ｂ．上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。

ｃ．委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ　収益分配金、償還金の支払い

（イ）収益分配金

ａ．分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

ｂ．分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して５営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録さ

れている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払われます。
ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（ロ）償還金

償還金は、信託終了後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して５営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払われます。

ハ　信託約款の変更等

（イ）委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。

（ロ）委託会社は、上記（イ）の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

（ハ）上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

（ニ）書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います（書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。）。

（ホ）上記（ロ）から（ニ）までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

（ヘ）上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

ニ　反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第 18 条第１項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

ホ　販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの）は、期間満了の３ヵ月前に当事者のいずれからも、何らの意思表示もない場合は、自動的に１年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

ヘ　委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

ト　公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

https://www.smd-am.co.jp

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ　運用報告書（運用状況に係る情報）

委託会社は毎決算時および償還時に、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書（全体版）および運用報告書（全体版）の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。

交付運用報告書は、受益者に対し、原則として販売会社を通じて、書面交付または電磁的方法のいずれかの方法で提供されます。

運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（https://www.smd-am.co.jp）に掲載されますが、受益者から請求があった場合には書面交付されます。

4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ　分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して５営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から５年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ロ　償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して５営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ハ　一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第２　管理及び運営　２　換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

ニ　書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行使することができます。

ホ　帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第３【ファンドの経理状況】

１．当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）ならびに同規則第 2 条の 2 の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

２．当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 7 期（2023 年 9 月 16 日から 2024 年 9 月 17 日まで）の財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人により監査を受けております。

# 独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2024年12月4日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2023年9月16日から2024年9月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

---

（注）1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

1【財務諸表】

【三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型)】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第6期<br>(2023年 9月15日現在) | 第7期<br>(2024年 9月17日現在) |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 9,556,244 | 18,185,201 |
| 金銭信託 | 5,785,640 | 1,653,096 |
| コール・ローン | 156,721,369 | 164,357,040 |
| 投資証券 | 205,066,890 | 114,537,710 |
| 親投資信託受益証券 | 10,126,803,515 | 12,624,151,989 |
| 未収入金 | 3,000,000 | 28,000,000 |
| 流動資産合計 | 10,506,933,658 | 12,950,885,036 |
| 資産合計 | 10,506,933,658 | 12,950,885,036 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 23,448,742 | 39,958,473 |
| 未払受託者報酬 | 1,604,721 | 2,063,353 |
| 未払委託者報酬 | 45,468,244 | 58,463,193 |
| その他未払費用 | 321,229 | 412,622 |
| 流動負債合計 | 70,842,936 | 100,897,641 |
| 負債合計 | 70,842,936 | 100,897,641 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 10,154,942,383 | 12,207,789,370 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 281,148,339 | 642,198,025 |
| （分配準備積立金） | 348,905,441 | 429,921,745 |
| 元本等合計 | 10,436,090,722 | 12,849,987,395 |
| 純資産合計 | 10,436,090,722 | 12,849,987,395 |
| 負債純資産合計 | 10,506,933,658 | 12,950,885,036 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第６期<br>自　2022年９月16日<br>至　2023年９月15日 | 第７期<br>自　2023年９月16日<br>至　2024年９月17日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 8,192,557 | 9,384,260 |
| 受取利息 | 70,246 | 314,223 |
| 有価証券売買等損益 | 107,014,194 | 380,619,008 |
| 為替差損益 | 7,842,082 | △4,333,627 |
| 営業収益合計 | 123,119,079 | 385,983,864 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 67,245 | 16,602 |
| 受託者報酬 | 2,951,927 | 3,872,969 |
| 委託者報酬 | 83,640,671 | 109,736,840 |
| その他費用 | 613,152 | 809,797 |
| 営業費用合計 | 87,272,995 | 114,436,208 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 35,846,084 | 271,547,656 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 35,846,084 | 271,547,656 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | 35,846,084 | 271,547,656 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△） | △11,182,891 | 29,170,558 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 214,163,854 | 281,148,339 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 47,770,916 | 167,898,725 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | － | － |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 47,770,916 | 167,898,725 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 27,815,406 | 49,226,137 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 27,815,406 | 49,226,137 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | － | － |
| 分配金 | － | － |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 281,148,339 | 642,198,025 |

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 第７期<br>自 2023年９月16日<br>至 2024年９月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| ３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | (1) 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。<br>(2) 計算期間の取扱い<br>当計算期間は当期末が休日のため、2023年９月16日から2024年９月17日までとなっております。 |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | 第６期<br>（2023年９月15日現在） | 第７期<br>（2024年９月17日現在） |
|---|---|---|
| １．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 10,154,942,383口 | 12,207,789,370口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　1.0277円<br>（１万口当たりの純資産額10,277円） | １口当たり純資産額　1.0526円<br>（１万口当たりの純資産額10,526円） |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 項　目 | 第6期<br>自 2022年9月16日<br>至 2023年9月15日 | 第7期<br>自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|---|
| 分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（80,249,179円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（751,603,461円）、および分配準備積立金（268,656,262円）より、分配対象収益は1,100,508,902円（1万口当たり1,083.72円）でありますが、分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（130,712,181円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（1,027,068,972円）、および分配準備積立金（299,209,564円）より、分配対象収益は1,456,990,717円（1万口当たり1,193.49円）でありますが、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

| 項　目 | 第7期<br>自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| 1．　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容<br>1) 有価証券<br>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。<br>2) デリバティブ取引<br>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。<br>当計算期間については、為替予約取引を行っております。<br>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>(2) 金融商品に係るリスク<br>有価証券およびデリバティブ取引等<br>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |
| 3．　金融商品に係るリスク管理体制 | リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。<br>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等 |

| | |
|---|---|
| | を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。<br>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。 |

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | 第7期<br>(2024年9月17日現在) |
|---|---|
| 1．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2022年9月16日　至 2023年9月15日）

| 種　類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|---|---|
| 投資証券 | △380,727円 |
| 親投資信託受益証券 | 205,095,648円 |
| 合計 | 204,714,921円 |

第7期（自 2023年9月16日　至 2024年9月17日）

| 種　類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|---|---|

| | |
|---|---|
| 投資証券 | 11,022,067円 |
| 親投資信託受益証券 | 359,420,631円 |
| 合計 | 370,442,698円 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| 第7期<br>自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| 項　目 | 第6期<br>(2023年9月15日現在) | 第7期<br>(2024年9月17日現在) |
|---|---|---|
| 期首元本額 | 7,722,564,936円 | 10,154,942,383円 |
| 期中追加設定元本額 | 3,585,355,935円 | 3,763,691,049円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,152,978,488円 | 1,710,844,062円 |

(4)【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ・ドル | iシェアーズ　J．P．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF | 8,691.00 | 813,651.42 | |
| | アメリカ・ドル小計 | | 8,691.00 | 813,651.42<br>(114,537,710) | |
| 投資証券合計 | | | | 114,537,710<br>(114,537,710) | |
| 親投資信託受益証券 | 日本・円 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 217,043,290 | 989,869,332 | |
| | | 外国株式インデックス・マザーファンド | 157,575,065 | 1,389,181,773 | |
| | | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 3,398,635,377 | 4,231,301,044 | |
| | | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 394,400,984 | 878,370,431 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 3,838,117,862 | 4,617,639,599 | |
| | | Ｊリート・インデックス・マザーファンド | 48,821,857 | 127,805,857 | |
| | | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 38,740,973 | 139,494,621 | |
| | | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 126,064,083 | 250,489,332 | |
| | 日本・円小計 | | 8,219,399,491 | 12,624,151,989 | |
| 親投資信託受益証券合計 | | | | 12,624,151,989<br>(-) | |
| 合　計 | | | | 12,738,689,699<br>(114,537,710) | |

（注）金額欄の(　)内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 通　貨 | 銘柄数 | | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 投資証券 | 1銘柄 | 0.9% | 100.0% |

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

# 独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2024年12月4日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）の2023年9月16日から2024年9月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

---

（注）1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

【三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型)】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第６期<br>(2023年 9月15日現在) | 第７期<br>(2024年 9月17日現在) |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 7,320,089 | 14,111,144 |
| 金銭信託 | 2,690,057 | 880,596 |
| コール・ローン | 72,868,237 | 87,552,212 |
| 投資証券 | 154,666,233 | 129,983,366 |
| 親投資信託受益証券 | 5,039,377,757 | 6,698,550,681 |
| 未収入金 | 15,000,000 | － |
| 流動資産合計 | 5,291,922,373 | 6,931,077,999 |
| 資産合計 | 5,291,922,373 | 6,931,077,999 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 20,167,618 | 9,302,687 |
| 未払受託者報酬 | 802,503 | 1,126,927 |
| 未払委託者報酬 | 22,738,929 | 31,931,148 |
| その他未払費用 | 160,603 | 225,333 |
| 流動負債合計 | 43,869,653 | 42,586,095 |
| 負債合計 | 43,869,653 | 42,586,095 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 4,446,804,336 | 5,555,527,628 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 801,248,384 | 1,332,964,276 |
| （分配準備積立金） | 315,401,783 | 547,844,533 |
| 元本等合計 | 5,248,052,720 | 6,888,491,904 |
| 純資産合計 | 5,248,052,720 | 6,888,491,904 |
| 負債純資産合計 | 5,291,922,373 | 6,931,077,999 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第６期<br>自　2022年９月16日<br>至　2023年９月15日 | 第７期<br>自　2023年９月16日<br>至　2024年９月17日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 6,190,644 | 7,354,683 |
| 受取利息 | 53,650 | 217,460 |
| 有価証券売買等損益 | 253,673,145 | 347,098,976 |
| 為替差損益 | 6,003,887 | △5,659,876 |
| 営業収益合計 | 265,921,326 | 349,011,243 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 31,593 | 7,846 |
| 受託者報酬 | 1,477,593 | 2,057,806 |
| 委託者報酬 | 41,867,699 | 58,307,336 |
| その他費用 | 314,586 | 452,178 |
| 営業費用合計 | 43,691,471 | 60,825,166 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 222,229,855 | 288,186,077 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 222,229,855 | 288,186,077 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | 222,229,855 | 288,186,077 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△） | 1,781,747 | 23,693,280 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 461,221,723 | 801,248,384 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 174,470,925 | 367,161,838 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | － | － |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 174,470,925 | 367,161,838 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 54,892,372 | 99,938,743 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 54,892,372 | 99,938,743 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | － | － |
| 分配金 | － | － |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 801,248,384 | 1,332,964,276 |

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 第７期<br>自 2023年９月16日<br>至 2024年９月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| ３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | (1) 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。<br>(2) 計算期間の取扱い<br>当計算期間は当期末が休日のため、2023年９月16日から2024年９月17日までとなっております。 |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | 第６期<br>(2023年９月15日現在) | 第７期<br>(2024年９月17日現在) |
|---|---|---|
| １．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 4,446,804,336口 | 5,555,527,628口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　1.1802円<br>（１万口当たりの純資産額11,802円） | １口当たり純資産額　1.2399円<br>（１万口当たりの純資産額12,399円） |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 項　目 | 第6期<br>自 2022年9月16日<br>至 2023年9月15日 | 第7期<br>自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|---|
| 分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（77,681,002円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（2,402,751円）、収益調整金（485,846,601円）、および分配準備積立金（235,318,030円）より、分配対象収益は801,248,384円（1万口当たり1,801.85円）でありますが、分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（96,646,044円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（167,846,753円）、収益調整金（785,119,743円）、および分配準備積立金（283,351,736円）より、分配対象収益は1,332,964,276円（1万口当たり2,399.35円）でありますが、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

| 項　目 | 第7期<br>自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| 1．　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容<br>1) 有価証券<br>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。<br>2) デリバティブ取引<br>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。<br>当計算期間については、為替予約取引を行っております。<br>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>(2) 金融商品に係るリスク<br>有価証券およびデリバティブ取引等<br>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |
| 3．　金融商品に係るリスク管理体制 | リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。<br>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等 |

| | |
|---|---|
| | を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。<br>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。 |

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | 第7期<br>(2024年9月17日現在) |
|---|---|
| 1．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2022年9月16日　至 2023年9月15日）

| 種　類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|---|---|
| 投資証券 | △404,669円 |
| 親投資信託受益証券 | 275,293,105円 |
| 合計 | 274,888,436円 |

第7期（自 2023年9月16日　至 2024年9月17日）

| 種　類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|---|---|

| | |
|---|---|
| 投資証券 | 12,347,021円 |
| 親投資信託受益証券 | 331,664,872円 |
| 合計 | 344,011,893円 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| 第7期<br>自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| 項　目 | 第6期<br>(2023年9月15日現在) | 第7期<br>(2024年9月17日現在) |
|---|---|---|
| 期首元本額 | 3,502,252,280円 | 4,446,804,336円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,371,817,336円 | 1,652,333,710円 |
| 期中一部解約元本額 | 427,265,280円 | 543,610,418円 |

(4)【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ・ドル | iシェアーズ　J．P．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF | 9,863.00 | 923,374.06 | |
| | アメリカ・ドル小計 | | 9,863.00 | 923,374.06<br>(129,983,366) | |
| 投資証券合計 | | | | 129,983,366<br>(129,983,366) | |
| 親投資信託受益証券 | 日本・円 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 217,081,439 | 990,043,318 | |
| | | 外国株式インデックス・マザーファンド | 145,828,305 | 1,285,622,336 | |
| | | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 1,573,946,740 | 1,959,563,691 | |
| | | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 272,850,257 | 607,664,807 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 1,152,749,545 | 1,386,872,977 | |
| | | Ｊリート・インデックス・マザーファンド | 52,586,537 | 137,661,036 | |
| | | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 38,588,464 | 138,945,482 | |
| | | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 96,717,179 | 192,177,034 | |
| | 日本・円小計 | | 3,550,348,466 | 6,698,550,681 | |
| 親投資信託受益証券合計 | | | | 6,698,550,681<br>(-) | |
| 合　計 | | | | 6,828,534,047<br>(129,983,366) | |

（注）金額欄の(　)内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 通　貨 | 銘柄数 | | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 投資証券 | 1銘柄 | 1.9% | 100.0% |

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

# 独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2024年12月4日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）の2023年9月16日から2024年9月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

---

（注）1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

【三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型)】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第６期<br>(2023年 9月15日現在) | 第７期<br>(2024年 9月17日現在) |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 26,119,836 | 25,917,554 |
| 金銭信託 | 6,661,277 | 2,372,036 |
| コール・ローン | 180,440,627 | 235,836,795 |
| 投資証券 | 564,037,125 | 582,994,442 |
| 親投資信託受益証券 | 14,003,527,217 | 19,414,065,618 |
| 流動資産合計 | 14,780,786,082 | 20,261,186,445 |
| 資産合計 | 14,780,786,082 | 20,261,186,445 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 1,366,130 | 6,389,601 |
| 未払受託者報酬 | 2,174,980 | 3,259,079 |
| 未払委託者報酬 | 61,625,838 | 92,342,051 |
| その他未払費用 | 435,383 | 651,763 |
| 流動負債合計 | 65,602,331 | 102,642,494 |
| 負債合計 | 65,602,331 | 102,642,494 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 10,913,676,279 | 13,940,089,702 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 3,801,507,472 | 6,218,454,249 |
| （分配準備積立金） | 1,700,099,921 | 2,589,438,084 |
| 元本等合計 | 14,715,183,751 | 20,158,543,951 |
| 純資産合計 | 14,715,183,751 | 20,158,543,951 |
| 負債純資産合計 | 14,780,786,082 | 20,261,186,445 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第６期<br>自　2022年９月16日<br>至　2023年９月15日 | 第７期<br>自　2023年９月16日<br>至　2024年９月17日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 22,183,844 | 28,262,367 |
| 受取利息 | 188,952 | 660,785 |
| 有価証券売買等損益 | 1,163,208,582 | 1,298,516,917 |
| 為替差損益 | 21,673,698 | △25,262,248 |
| 営業収益合計 | 1,207,255,076 | 1,302,177,821 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 86,387 | 21,876 |
| 受託者報酬 | 3,956,698 | 5,868,151 |
| 委託者報酬 | 112,109,088 | 166,266,985 |
| その他費用 | 845,252 | 1,281,466 |
| 営業費用合計 | 116,997,425 | 173,438,478 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 1,090,257,651 | 1,128,739,343 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 1,090,257,651 | 1,128,739,343 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | 1,090,257,651 | 1,128,739,343 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△） | 14,376,767 | 80,277,882 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 2,034,902,796 | 3,801,507,472 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 923,069,481 | 1,795,783,706 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | － | － |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 923,069,481 | 1,795,783,706 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 232,345,689 | 427,298,390 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 232,345,689 | 427,298,390 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | － | － |
| 分配金 | － | － |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 3,801,507,472 | 6,218,454,249 |

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 第７期<br>自 2023年９月16日<br>至 2024年９月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| ３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | (1) 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。<br>(2) 計算期間の取扱い<br>当計算期間は当期末が休日のため、2023年９月16日から2024年９月17日までとなっております。 |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | 第６期<br>（2023年９月15日現在） | 第７期<br>（2024年９月17日現在） |
|---|---|---|
| １．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 10,913,676,279口 | 13,940,089,702口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　1.3483円<br>（１万口当たりの純資産額13,483円） | １口当たり純資産額　1.4461円<br>（１万口当たりの純資産額14,461円） |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 項　目 | 第6期<br>自 2022年9月16日<br>至 2023年9月15日 | 第7期<br>自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|---|
| 分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（245,228,201円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（657,885,929円）、収益調整金（2,101,407,551円）、および分配準備積立金（796,985,791円）より、分配対象収益は3,801,507,472円（１万口当たり3,483.25円）でありますが、分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（319,120,494円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（729,340,967円）、収益調整金（3,629,016,165円）、および分配準備積立金（1,540,976,623円）より、分配対象収益は6,218,454,249円（１万口当たり4,460.84円）でありますが、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

| 項　目 | 第7期<br>自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| １．　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| ２．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容<br>1) 有価証券<br>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。<br>2) デリバティブ取引<br>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。<br>当計算期間については、為替予約取引を行っております。<br>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>(2) 金融商品に係るリスク<br>有価証券およびデリバティブ取引等<br>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |
| ３．　金融商品に係るリスク管理体制 | リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。<br>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制につい |

| | |
|---|---|
| | ては、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。<br>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。 |

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | 第7期<br>(2024年9月17日現在) |
|---|---|
| 1．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2022年9月16日　至 2023年9月15日）

| 種　類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|---|---|
| 投資証券 | △713,518円 |
| 親投資信託受益証券 | 1,202,300,271円 |
| 合計 | 1,201,586,753円 |

第7期（自 2023年9月16日　至 2024年9月17日）

| 種　類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|---|---|
| 投資証券 | 52,628,626円 |
| 親投資信託受益証券 | 1,239,024,363円 |
| 合計 | 1,291,652,989円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第7期<br>自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

（その他の注記）

| 項　目 | 第6期<br>（2023年9月15日現在） | 第7期<br>（2024年9月17日現在） |
|---|---|---|
| 期首元本額 | 8,267,467,501円 | 10,913,676,279円 |
| 期中追加設定元本額 | 3,603,123,946円 | 4,235,031,216円 |
| 期中一部解約元本額 | 956,915,168円 | 1,208,617,793円 |

（４）【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ・ドル | ｉシェアーズ　Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ | 44,237.00 | 4,141,467.94 | |
| | アメリカ・ドル小計 | | 44,237.00 | 4,141,467.94<br>(582,994,442) | |
| 投資証券合計 | | | | 582,994,442<br>(582,994,442) | |
| 親投資信託受益証券 | 日本・円 | 国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号） | 899,181,126 | 4,100,895,361 | |
| | | 外国株式インデックス・マザーファンド | 585,211,507 | 5,159,224,645 | |
| | | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 2,650,606,842 | 3,300,005,518 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 800,274,081 | 1,782,290,405 | |
| | | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 2,399,387,825 | 2,886,703,492 | |
| | | Ｊリート・インデックス・マザーファンド | 239,482,273 | 626,916,694 | |
| | | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 167,348,435 | 602,571,509 | |
| | | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 480,854,552 | 955,457,994 | |
| | 日本・円小計 | | 8,222,346,641 | 19,414,065,618 | |
| 親投資信託受益証券合計 | | | | 19,414,065,618<br>(-) | |
| 合　計 | | | | 19,997,060,060<br>(582,994,442) | |

（注）金額欄の(　)内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 通　貨 | 銘柄数 | | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 投資証券 | 1銘柄 | 2.9% | 100.0% |

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

# 独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2024年12月4日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）の2023年9月16日から2024年9月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

---

（注）1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

【三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型)】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第６期<br>(2023年 9月15日現在) | 第７期<br>(2024年 9月17日現在) |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 15,039,419 | 14,798,754 |
| 金銭信託 | 3,143,390 | 1,297,041 |
| コール・ローン | 85,148,125 | 128,956,737 |
| 投資証券 | 339,160,150 | 361,852,711 |
| 親投資信託受益証券 | 6,484,820,833 | 9,370,990,828 |
| 流動資産合計 | 6,927,311,917 | 9,877,896,071 |
| 資産合計 | 6,927,311,917 | 9,877,896,071 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 4,306,890 | 8,970,761 |
| 未払受託者報酬 | 998,198 | 1,585,930 |
| 未払委託者報酬 | 28,283,525 | 44,935,940 |
| その他未払費用 | 199,781 | 317,136 |
| 流動負債合計 | 33,788,394 | 55,809,767 |
| 負債合計 | 33,788,394 | 55,809,767 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 4,611,698,310 | 6,018,491,745 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 2,281,825,213 | 3,803,594,559 |
| （分配準備積立金） | 1,057,078,513 | 1,566,522,192 |
| 元本等合計 | 6,893,523,523 | 9,822,086,304 |
| 純資産合計 | 6,893,523,523 | 9,822,086,304 |
| 負債純資産合計 | 6,927,311,917 | 9,877,896,071 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第６期<br>自　2022年９月16日<br>至　2023年９月15日 | 第７期<br>自　2023年９月16日<br>至　2024年９月17日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 12,668,632 | 16,921,310 |
| 受取利息 | 108,752 | 370,389 |
| 有価証券売買等損益 | 726,532,575 | 751,501,544 |
| 為替差損益 | 12,878,063 | △16,308,390 |
| 営業収益合計 | 752,188,022 | 752,484,853 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 38,877 | 9,823 |
| 受託者報酬 | 1,804,562 | 2,811,029 |
| 委託者報酬 | 51,131,595 | 79,648,724 |
| その他費用 | 396,575 | 641,589 |
| 営業費用合計 | 53,371,609 | 83,111,165 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 698,816,413 | 669,373,688 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 698,816,413 | 669,373,688 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | 698,816,413 | 669,373,688 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△） | 10,909,102 | 51,899,995 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 1,169,718,632 | 2,281,825,213 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 592,721,442 | 1,188,137,012 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | － | － |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 592,721,442 | 1,188,137,012 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 168,522,172 | 283,841,359 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 168,522,172 | 283,841,359 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | － | － |
| 分配金 | － | － |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 2,281,825,213 | 3,803,594,559 |

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 第７期<br>自 2023年９月16日<br>至 2024年９月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| ３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | (1) 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。<br>(2) 計算期間の取扱い<br>当計算期間は当期末が休日のため、2023年９月16日から2024年９月17日までとなっております。 |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | 第６期<br>(2023年９月15日現在) | 第７期<br>(2024年９月17日現在) |
|---|---|---|
| １．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 4,611,698,310口 | 6,018,491,745口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　1.4948円<br>（１万口当たりの純資産額14,948円） | １口当たり純資産額　1.6320円<br>（１万口当たりの純資産額16,320円） |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 項　目 | 第6期<br>自 2022年9月16日<br>至 2023年9月15日 | 第7期<br>自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|---|
| 分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（122,962,671円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（559,224,480円）、収益調整金（1,224,746,700円）、および分配準備積立金（374,891,362円）より、分配対象収益は2,281,825,213円（1万口当たり4,947.91円）でありますが、分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（167,217,202円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（450,256,491円）、収益調整金（2,237,072,367円）、および分配準備積立金（949,048,499円）より、分配対象収益は3,803,594,559円（1万口当たり6,319.85円）でありますが、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

| 項　目 | 第7期<br>自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| 1．　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容<br>1) 有価証券<br>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。<br>2) デリバティブ取引<br>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。<br>当計算期間については、為替予約取引を行っております。<br>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>(2) 金融商品に係るリスク<br>有価証券およびデリバティブ取引等<br>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |
| 3．　金融商品に係るリスク管理体制 | リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。<br>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等 |

| | |
|---|---|
| | を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。<br>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。 |

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | 第7期<br>(2024年9月17日現在) |
|---|---|
| 1．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自　2022年9月16日　至　2023年9月15日）

| 種　類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|---|---|
| 投資証券 | △748,879円 |
| 親投資信託受益証券 | 718,339,102円 |
| 合計 | 717,590,223円 |

第7期（自　2023年9月16日　至　2024年9月17日）

| 種　類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|---|---|

| | |
|---|---|
| 投資証券 | 31,760,646円 |
| 親投資信託受益証券 | 704,047,650円 |
| 合計 | 735,808,296円 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| 第7期<br>自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| 項　目 | 第6期<br>(2023年9月15日現在) | 第7期<br>(2024年9月17日現在) |
|---|---|---|
| 期首元本額 | 3,461,108,415円 | 4,611,698,310円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,655,293,434円 | 1,970,467,183円 |
| 期中一部解約元本額 | 504,703,539円 | 563,673,748円 |

(4)【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ・ドル | iシェアーズ　J．P．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF | 27,457.00 | 2,570,524.34 | |
| | アメリカ・ドル小計 | | 27,457.00 | 2,570,524.34<br>(361,852,711) | |
| 投資証券合計 | | | | 361,852,711<br>(361,852,711) | |
| 親投資信託受益証券 | 日本・円 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 548,021,447 | 2,499,361,413 | |
| | | 外国株式インデックス・マザーファンド | 363,159,021 | 3,201,609,929 | |
| | | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 730,726,946 | 909,755,047 | |
| | | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 261,559,099 | 582,518,269 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 582,772,045 | 701,133,047 | |
| | | Ｊリート・インデックス・マザーファンド | 156,128,374 | 408,712,857 | |
| | | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 112,510,735 | 405,117,403 | |
| | | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 333,559,569 | 662,782,863 | |
| | 日本・円小計 | | 3,088,437,236 | 9,370,990,828 | |
| 親投資信託受益証券合計 | | | | 9,370,990,828<br>(-) | |
| 合　計 | | | | 9,732,843,539<br>(361,852,711) | |

（注）金額欄の(　)内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 通　貨 | 銘柄数 | | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 投資証券 | 1銘柄 | 3.7% | 100.0% |

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

# 独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2024年12月4日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）の2023年9月16日から2024年9月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）の2024年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

---

（注）1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

【三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型)】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第６期<br>(2023年 9月15日現在) | 第７期<br>(2024年 9月17日現在) |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 17,943,594 | 14,729,736 |
| 金銭信託 | 3,084,890 | 1,362,405 |
| コール・ローン | 83,563,489 | 135,455,490 |
| 投資証券 | 400,453,852 | 497,647,967 |
| 親投資信託受益証券 | 6,438,063,615 | 9,942,002,085 |
| 流動資産合計 | 6,943,109,440 | 10,591,197,683 |
| 資産合計 | 6,943,109,440 | 10,591,197,683 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 5,493,992 | 11,113,606 |
| 未払受託者報酬 | 999,328 | 1,700,593 |
| 未払委託者報酬 | 28,315,588 | 48,184,943 |
| その他未払費用 | 200,010 | 340,063 |
| 流動負債合計 | 35,008,918 | 61,339,205 |
| 負債合計 | 35,008,918 | 61,339,205 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 4,260,660,672 | 5,830,554,033 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 2,647,439,850 | 4,699,304,445 |
| （分配準備積立金） | 1,283,313,753 | 1,844,981,656 |
| 元本等合計 | 6,908,100,522 | 10,529,858,478 |
| 純資産合計 | 6,908,100,522 | 10,529,858,478 |
| 負債純資産合計 | 6,943,109,440 | 10,591,197,683 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第６期<br>自　2022年９月16日<br>至　2023年９月15日 | 第７期<br>自　2023年９月16日<br>至　2024年９月17日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 15,106,077 | 21,225,231 |
| 受取利息 | 129,247 | 420,076 |
| 有価証券売買等損益 | 911,458,824 | 900,986,755 |
| 為替差損益 | 15,881,579 | △23,710,890 |
| 営業収益合計 | 942,575,727 | 898,921,172 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 39,418 | 9,965 |
| 受託者報酬 | 1,794,221 | 2,942,838 |
| 委託者報酬 | 50,838,894 | 83,383,071 |
| その他費用 | 400,441 | 682,400 |
| 営業費用合計 | 53,072,974 | 87,018,274 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 889,502,753 | 811,902,898 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 889,502,753 | 811,902,898 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | 889,502,753 | 811,902,898 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△） | 29,769,800 | 85,120,286 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 1,323,842,919 | 2,647,439,850 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 732,348,188 | 1,757,649,739 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | － | － |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 732,348,188 | 1,757,649,739 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 268,484,210 | 432,567,756 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 268,484,210 | 432,567,756 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | － | － |
| 分配金 | － | － |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 2,647,439,850 | 4,699,304,445 |

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 第７期<br>自 2023年９月16日<br>至 2024年９月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| ３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | (1) 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。<br>(2) 計算期間の取扱い<br>当計算期間は当期末が休日のため、2023年９月16日から2024年９月17日までとなっております。 |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | 第６期<br>(2023年９月15日現在) | 第７期<br>(2024年９月17日現在) |
|---|---|---|
| １．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 4,260,660,672口 | 5,830,554,033口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　1.6214円<br>（１万口当たりの純資産額16,214円） | １口当たり純資産額　1.8060円<br>（１万口当たりの純資産額18,060円） |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 項　目 | 第6期<br>自 2022年9月16日<br>至 2023年9月15日 | 第7期<br>自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|---|
| 分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（127,643,047円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（732,089,906円）、収益調整金（1,364,126,097円）、および分配準備積立金（423,580,800円）より、分配対象収益は2,647,439,850円（１万口当たり6,213.68円）でありますが、分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（178,797,181円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（547,985,431円）、収益調整金（2,854,322,789円）、および分配準備積立金（1,118,199,044円）より、分配対象収益は4,699,304,445円（１万口当たり8,059.79円）でありますが、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

| 項　目 | 第7期<br>自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| １．　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| ２．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容<br>1) 有価証券<br>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。<br>2) デリバティブ取引<br>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。<br>当計算期間については、為替予約取引を行っております。<br>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>(2) 金融商品に係るリスク<br>有価証券およびデリバティブ取引等<br>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |
| ３．　金融商品に係るリスク管理体制 | リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。<br>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制につい |

| | |
|---|---|
| | ては、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。<br>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。 |

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | 第7期<br>(2024年9月17日現在) |
|---|---|
| 1．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2022年9月16日　至 2023年9月15日）

| 種　類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|---|---|
| 投資証券 | △957,550円 |
| 親投資信託受益証券 | 869,810,821円 |
| 合計 | 868,853,271円 |

第7期（自 2023年9月16日　至 2024年9月17日）

| 種　類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|---|---|
| 投資証券 | 42,434,718円 |
| 親投資信託受益証券 | 839,444,107円 |
| 合計 | 881,878,825円 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| 第7期<br>自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| 項　目 | 第6期<br>(2023年9月15日現在) | 第7期<br>(2024年9月17日現在) |
|---|---|---|
| 期首元本額 | 3,255,045,332円 | 4,260,660,672円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,671,376,606円 | 2,248,982,809円 |
| 期中一部解約元本額 | 665,761,266円 | 679,089,448円 |

(4)【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ・ドル | iシェアーズ　J．P．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF | 37,761.00 | 3,535,184.82 | |
| | アメリカ・ドル小計 | | 37,761.00 | 3,535,184.82<br>(497,647,967) | |
| 投資証券合計 | | | | 497,647,967<br>(497,647,967) | |
| 親投資信託受益証券 | 日本・円 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 676,073,072 | 3,083,366,459 | |
| | | 外国株式インデックス・マザーファンド | 522,081,349 | 4,602,669,172 | |
| | | ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド | 97,175,055 | 120,982,943 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 143,088,978 | 318,673,462 | |
| | | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 90,370,739 | 108,725,036 | |
| | | Ｊリート・インデックス・マザーファンド | 127,306,138 | 333,262,008 | |
| | | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 94,715,195 | 341,041,002 | |
| | | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 520,021,139 | 1,033,282,003 | |
| | 日本・円小計 | | 2,270,831,665 | 9,942,002,085 | |
| 親投資信託受益証券合計 | | | | 9,942,002,085<br>(-) | |
| 合　計 | | | | 10,439,650,052<br>(497,647,967) | |

（注）金額欄の(　)内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 通　貨 | 銘柄数 | | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 投資証券 | 1銘柄 | 4.7% | 100.0% |

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型)」、「三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型)」、「三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型)」、「三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型)」および「三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Ｊリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

（１）貸借対照表

（単位：円）

| | （2024年9月17日現在） |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 金銭信託 | 55,444,781 |
| コール・ローン | 5,512,530,223 |
| 株式 | 315,066,198,890 |
| 派生商品評価勘定 | 1,422,300 |
| 未収配当金 | 126,246,669 |
| 前払金 | 52,455,000 |
| 差入委託証拠金 | 498,631,311 |
| 流動資産合計 | 321,312,929,174 |
| 資産合計 | 321,312,929,174 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 78,637,900 |
| 未払解約金 | 1,428,210 |
| 流動負債合計 | 80,066,110 |
| 負債合計 | 80,066,110 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 70,434,529,577 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 250,798,333,487 |
| 元本等合計 | 321,232,863,064 |
| 純資産合計 | 321,232,863,064 |
| 負債純資産合計 | 321,312,929,174 |

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式、新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | (2024年9月17日現在) |
|---|---|
| １．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 70,434,529,577口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　4.5607円<br>（１万口当たりの純資産額45,607円） |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

| 項　目 | 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| １．　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| ２．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容<br>1) 有価証券<br>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券を組み入れております。 |

| | |
|---|---|
| | 2) デリバティブ取引<br>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。<br>当計算期間については、先物取引を行っております。<br>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>(2) 金融商品に係るリスク<br>有価証券およびデリバティブ取引等<br>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。<br>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。<br>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。 |

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | (2024年9月17日現在) |
|---|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券（株式）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 |

| | |
|---|---|
| | (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区 分 | 種 類 | 契約額等 | うち1年超 | 時 価 | 評価損益 |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | | | | |
| | TOPIX 先物 0612 月 | 6,312,085,600 | - | 6,234,870,000 | △77,215,600 |
| | 小計 | 6,312,085,600 | - | 6,234,870,000 | △77,215,600 |
| 合 計 | | 6,312,085,600 | - | 6,234,870,000 | △77,215,600 |

(注) 1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| (2024年9月17日現在) | |
|---|---|
| 開示対象ファンドの<br>期首における当該親投資信託の元本額 | 67,862,268,912円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 11,888,038,162円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 9,315,777,497円 |
| | |
| 2024年9月17日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド | 9,727,786,024円 |

| | |
|---|---|
| 三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型） | 950,626,917 円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型） | 4,198,280,243 円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型） | 3,629,488,300 円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 133,495,524 円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ） | 3,042,957 円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ） | 11,977,031 円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ） | 42,887,777 円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ） | 124,903,411 円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ） | 124,228,530 円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ） | 253,304,691 円 |
| 国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ） | 1,591,991,652 円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド | 29,540,289,086 円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 105,178,908 円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 151,619,140 円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 92,399,058 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０ | 70,040,729 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 217,043,290 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 217,081,439 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 899,181,126 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 548,021,447 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 676,073,072 円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 66,541,957 円 |
| 三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド | 1,492,724,486 円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型） | 42,130,422 円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型） | 254,742,952 円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型） | 291,224,732 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０ | 9,795,302 円 |
| 日興ＦＷＳ・日本株インデックス | 2,801,593,926 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＴＯＰＩＸインデックス・ファンド | 228,075,914 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５ | 23,040,928 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０ | 14,474,296 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５ | 15,224,099 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５ | 8,267,077 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５ | 5,275,441 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 875,783 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 23,588,101 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 114,775,649 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 123,701,189 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 47,814,523 円 |
| ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 1,993,156,333 円 |
| バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞ | 6,728,503 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞ | 33,548,131 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 696,968,941 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞ | 977,324,801 円 |

| | |
|---|---|
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 3,842,256,121円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞ | 23,860,855円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞ | 91,834,407円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞ | 561,545,046円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞ | 29,035,936円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 155,287,022円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 543,730,636円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞ | 344,922,224円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞ | 1,024,338,247円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 22,216,667円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 23,652,147円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 17,992,772円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 13,108,995円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 53,729,988円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 143,857,608円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 28,624,594円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 28,432,856円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 6,486,356円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞ | 24,746,633円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞ | 324,341,423円 |
| ＳＭＡＭ・国内株式インデックスファンド・ＶＡ（適格機関投資家専用） | 147,428,669円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 132,037,002円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 53,003,126円 |
| ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 37,593,666円 |
| ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞ | 24,166,736円 |
| ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 25,219,091円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞ | 15,386,731円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞ | 24,463,796円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞ | 23,379,285円 |
| ＳＭＤＡＭ・日米３資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞ | 10,117,443円 |
| ＳＭＤＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定＞ | 57,199,661円 |
| 合　計 | 70,434,529,577円 |

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

（単位：円）

| 銘　柄 | 株　数 | 評価額 | | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| | | 単価 | 金額 | |
| 極洋 | 4,500 | 4,325.000 | 19,462,500 | |
| ニッスイ | 121,800 | 921.700 | 112,263,060 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| マルハニチロ | 18,000 | 3,088.000 | 55,584,000 | |
| 雪国まいたけ | 12,000 | 1,011.000 | 12,132,000 | |
| カネコ種苗 | 4,800 | 1,371.000 | 6,580,800 | |
| サカタのタネ | 13,600 | 3,355.000 | 45,628,000 | |
| ホクト | 10,100 | 1,808.000 | 18,260,800 | |
| 住石ホールディングス | 15,900 | 977.000 | 15,534,300 | |
| 日鉄鉱業 | 4,800 | 4,155.000 | 19,944,000 | |
| 三井松島ホールディングス | 7,500 | 4,600.000 | 34,500,000 | |
| ＩＮＰＥＸ | 370,800 | 1,849.000 | 685,609,200 | |
| 石油資源開発 | 13,800 | 5,260.000 | 72,588,000 | |
| Ｋ＆Ｏエナジーグループ | 5,800 | 3,250.000 | 18,850,000 | |
| ショーボンドホールディングス | 16,400 | 5,584.000 | 91,577,600 | |
| ミライト・ワン | 39,000 | 2,015.500 | 78,604,500 | |
| タマホーム | 7,900 | 3,920.000 | 30,968,000 | |
| 日本アクア | 3,300 | 868.000 | 2,864,400 | |
| 安藤・間 | 68,700 | 1,119.000 | 76,875,300 | |
| 東急建設 | 36,300 | 719.000 | 26,099,700 | |
| コムシスホールディングス | 38,200 | 3,125.000 | 119,375,000 | |
| ビーアールホールディングス | 18,500 | 361.000 | 6,678,500 | |
| 高松コンストラクショングループ | 8,800 | 2,977.000 | 26,197,600 | |
| 東建コーポレーション | 3,200 | 11,650.000 | 37,280,000 | |
| ヤマウラ | 6,300 | 1,127.000 | 7,100,100 | |
| オリエンタル白石 | 44,000 | 388.000 | 17,072,000 | |
| 大成建設 | 78,700 | 6,275.000 | 493,842,500 | |
| 大林組 | 307,300 | 1,807.000 | 555,291,100 | |
| 清水建設 | 244,000 | 999.700 | 243,926,800 | |
| 飛島建設 | 9,400 | 1,422.000 | 13,366,800 | |
| 長谷工コーポレーション | 78,700 | 1,883.000 | 148,192,100 | |
| 松井建設 | 9,700 | 744.000 | 7,216,800 | |
| 錢高組 | 1,500 | 3,400.000 | 5,100,000 | |
| 鹿島建設 | 190,000 | 2,595.500 | 493,145,000 | |
| 不動テトラ | 5,800 | 2,231.000 | 12,939,800 | |
| 鉄建建設 | 6,700 | 2,380.000 | 15,946,000 | |
| 西松建設 | 16,300 | 5,261.000 | 85,754,300 | |
| 三井住友建設 | 65,600 | 396.000 | 25,977,600 | |
| 大豊建設 | 3,800 | 3,515.000 | 13,357,000 | |
| 奥村組 | 13,400 | 4,370.000 | 58,558,000 | |
| 東鉄工業 | 10,900 | 3,395.000 | 37,005,500 | |
| 淺沼組 | 31,000 | 677.000 | 20,987,000 | |
| 戸田建設 | 116,800 | 985.600 | 115,118,080 | |
| 熊谷組 | 14,100 | 3,435.000 | 48,433,500 | |
| 北野建設 | 1,900 | 3,800.000 | 7,220,000 | |
| 矢作建設工業 | 11,500 | 1,575.000 | 18,112,500 | |
| ピーエス・コンストラクション | 10,900 | 1,004.000 | 10,943,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日本ハウスホールディングス | 19,500 | 359.000 | 7,000,500 | |
| 新日本建設 | 11,500 | 1,591.000 | 18,296,500 | |
| 東亜道路工業 | 17,000 | 1,345.000 | 22,865,000 | |
| 日本道路 | 9,900 | 1,679.000 | 16,622,100 | |
| 東亜建設工業 | 26,800 | 917.000 | 24,575,600 | |
| 日本国土開発 | 24,300 | 495.000 | 12,028,500 | |
| 若築建設 | 3,200 | 3,255.000 | 10,416,000 | |
| 東洋建設 | 22,400 | 1,342.000 | 30,060,800 | |
| 五洋建設 | 119,400 | 595.000 | 71,043,000 | |
| 世紀東急工業 | 10,800 | 1,579.000 | 17,053,200 | |
| 福田組 | 3,100 | 5,400.000 | 16,740,000 | |
| 住友林業 | 74,500 | 6,420.000 | 478,290,000 | |
| 巴コーポレーション | 11,300 | 915.000 | 10,339,500 | |
| 大和ハウス工業 | 237,300 | 4,573.000 | 1,085,172,900 | |
| ライト工業 | 16,100 | 2,109.000 | 33,954,900 | |
| 積水ハウス | 260,000 | 3,808.000 | 990,080,000 | |
| 日特建設 | 6,800 | 1,003.000 | 6,820,400 | |
| 北陸電気工事 | 5,600 | 1,174.000 | 6,574,400 | |
| ユアテック | 19,100 | 1,532.000 | 29,261,200 | |
| 日本リーテック | 7,700 | 1,054.000 | 8,115,800 | |
| 四電工 | 3,500 | 3,880.000 | 13,580,000 | |
| 中電工 | 13,000 | 3,330.000 | 43,290,000 | |
| 関電工 | 53,300 | 2,213.000 | 117,952,900 | |
| きんでん | 59,700 | 3,286.000 | 196,174,200 | |
| 東京エネシス | 8,700 | 1,088.000 | 9,465,600 | |
| トーエネック | 2,900 | 4,815.000 | 13,963,500 | |
| 住友電設 | 8,100 | 4,015.000 | 32,521,500 | |
| 日本電設工業 | 14,700 | 1,759.000 | 25,857,300 | |
| エクシオグループ | 82,100 | 1,545.500 | 126,885,550 | |
| 新日本空調 | 5,500 | 3,365.000 | 18,507,500 | |
| 九電工 | 18,600 | 6,530.000 | 121,458,000 | |
| 三機工業 | 17,600 | 2,230.000 | 39,248,000 | |
| 日揮ホールディングス | 84,900 | 1,204.500 | 102,262,050 | |
| 中外炉工業 | 3,000 | 2,605.000 | 7,815,000 | |
| ヤマト | 7,000 | 957.000 | 6,699,000 | |
| 太平電業 | 5,500 | 5,120.000 | 28,160,000 | |
| 高砂熱学工業 | 22,900 | 5,130.000 | 117,477,000 | |
| 三晃金属工業 | 1,200 | 3,980.000 | 4,776,000 | |
| 朝日工業社 | 8,000 | 1,281.000 | 10,248,000 | |
| 明星工業 | 16,400 | 1,167.000 | 19,138,800 | |
| 大氣社 | 9,600 | 4,730.000 | 45,408,000 | |
| ダイダン | 11,200 | 2,942.000 | 32,950,400 | |
| 日比谷総合設備 | 6,400 | 3,300.000 | 21,120,000 | |
| テスホールディングス | 19,300 | 282.000 | 5,442,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| インフロニア・ホールディングス | 99,200 | 1,172.500 | 116,312,000 | |
| 東洋エンジニアリング | 12,300 | 698.000 | 8,585,400 | |
| レイズネクスト | 12,800 | 1,603.000 | 20,518,400 | |
| ニップン | 24,500 | 2,216.000 | 54,292,000 | |
| 日清製粉グループ本社 | 79,700 | 1,858.000 | 148,082,600 | |
| 日東富士製粉 | 1,700 | 6,890.000 | 11,713,000 | |
| 昭和産業 | 7,200 | 2,888.000 | 20,793,600 | |
| 鳥越製粉 | 10,700 | 681.000 | 7,286,700 | |
| 中部飼料 | 12,100 | 1,485.000 | 17,968,500 | |
| フィード・ワン | 12,900 | 833.000 | 10,745,700 | |
| 日本甜菜製糖 | 5,200 | 2,777.000 | 14,440,400 | |
| ＤＭ三井製糖ホールディングス | 8,300 | 3,335.000 | 27,680,500 | |
| ウェルネオシュガー | 4,700 | 2,160.000 | 10,152,000 | |
| 森永製菓 | 35,700 | 2,895.500 | 103,369,350 | |
| 中村屋 | 3,100 | 3,230.000 | 10,013,000 | |
| 江崎グリコ | 24,600 | 4,323.000 | 106,345,800 | |
| 井村屋グループ | 4,600 | 2,529.000 | 11,633,400 | |
| 不二家 | 5,700 | 2,718.000 | 15,492,600 | |
| 山崎製パン | 58,000 | 2,779.000 | 161,182,000 | |
| モロゾフ | 2,600 | 4,495.000 | 11,687,000 | |
| 亀田製菓 | 5,100 | 4,510.000 | 23,001,000 | |
| 寿スピリッツ | 40,800 | 1,722.500 | 70,278,000 | |
| カルビー | 39,700 | 3,414.000 | 135,535,800 | |
| 森永乳業 | 30,100 | 3,450.000 | 103,845,000 | |
| 六甲バター | 6,300 | 1,518.000 | 9,563,400 | |
| ヤクルト本社 | 123,400 | 3,182.000 | 392,658,800 | |
| 明治ホールディングス | 105,500 | 3,681.000 | 388,345,500 | |
| 雪印メグミルク | 20,900 | 2,635.000 | 55,071,500 | |
| プリマハム | 10,700 | 2,342.000 | 25,059,400 | |
| 日本ハム | 37,000 | 5,428.000 | 200,836,000 | |
| 丸大食品 | 8,400 | 1,782.000 | 14,968,800 | |
| Ｓ　Ｆｏｏｄｓ | 9,400 | 2,680.000 | 25,192,000 | |
| 柿安本店 | 3,100 | 2,661.000 | 8,249,100 | |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 12,700 | 3,865.000 | 49,085,500 | |
| サッポロホールディングス | 28,500 | 7,655.000 | 218,167,500 | |
| アサヒグループホールディングス | 215,900 | 5,479.000 | 1,182,916,100 | |
| キリンホールディングス | 359,000 | 2,177.000 | 781,543,000 | |
| 宝ホールディングス | 57,100 | 1,156.500 | 66,036,150 | |
| オエノンホールディングス | 28,500 | 396.000 | 11,286,000 | |
| 養命酒製造 | 2,800 | 2,253.000 | 6,308,400 | |
| コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス | 62,500 | 2,085.500 | 130,343,750 | |
| ライフドリンク　カンパニー | 2,100 | 7,600.000 | 15,960,000 | |
| サントリー食品インターナショナル | 60,800 | 5,553.000 | 337,622,400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ダイドーグループホールディングス | 9,400 | 2,980.000 | 28,012,000 | |
| 伊藤園 | 29,000 | 3,266.000 | 94,714,000 | |
| キーコーヒー | 9,800 | 2,045.000 | 20,041,000 | |
| 日清オイリオグループ | 11,600 | 5,370.000 | 62,292,000 | |
| 不二製油グループ本社 | 20,400 | 3,347.000 | 68,278,800 | |
| かどや製油 | 1,800 | 3,660.000 | 6,588,000 | |
| Ｊ－オイルミルズ | 8,500 | 1,974.000 | 16,779,000 | |
| キッコーマン | 285,500 | 1,605.000 | 458,227,500 | |
| 味の素 | 202,000 | 5,346.000 | 1,079,892,000 | |
| ブルドックソース | 4,700 | 1,771.000 | 8,323,700 | |
| キユーピー | 46,700 | 3,579.000 | 167,139,300 | |
| ハウス食品グループ本社 | 28,600 | 3,010.000 | 86,086,000 | |
| カゴメ | 36,900 | 3,116.000 | 114,980,400 | |
| アリアケジャパン | 8,800 | 5,060.000 | 44,528,000 | |
| エバラ食品工業 | 2,800 | 2,755.000 | 7,714,000 | |
| やまみ | 900 | 4,775.000 | 4,297,500 | |
| ニチレイ | 39,500 | 4,461.000 | 176,209,500 | |
| 東洋水産 | 43,600 | 9,231.000 | 402,471,600 | |
| イートアンドホールディングス | 4,100 | 2,013.000 | 8,253,300 | |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 5,000 | 1,632.000 | 8,160,000 | |
| 日清食品ホールディングス | 91,000 | 3,957.000 | 360,087,000 | |
| フジッコ | 7,600 | 1,700.000 | 12,920,000 | |
| ロック・フィールド | 9,200 | 1,434.000 | 13,192,800 | |
| 日本たばこ産業 | 524,100 | 4,070.000 | 2,133,087,000 | |
| ケンコーマヨネーズ | 6,300 | 2,367.000 | 14,912,100 | |
| わらべや日洋ホールディングス | 6,200 | 2,329.000 | 14,439,800 | |
| なとり | 4,600 | 2,069.000 | 9,517,400 | |
| ファーマフーズ | 12,200 | 853.000 | 10,406,600 | |
| ユーグレナ | 55,500 | 458.000 | 25,419,000 | |
| 紀文食品 | 7,100 | 1,195.000 | 8,484,500 | |
| ピックルスホールディングス | 5,200 | 1,009.000 | 5,246,800 | |
| ミヨシ油脂 | 5,200 | 1,577.000 | 8,200,400 | |
| 理研ビタミン | 7,200 | 2,547.000 | 18,338,400 | |
| 片倉工業 | 9,000 | 2,015.000 | 18,135,000 | |
| グンゼ | 8,000 | 5,480.000 | 43,840,000 | |
| 東洋紡 | 47,000 | 970.000 | 45,590,000 | |
| ユニチカ | 30,500 | 285.000 | 8,692,500 | |
| 富士紡ホールディングス | 3,600 | 4,350.000 | 15,660,000 | |
| 倉敷紡績 | 8,000 | 4,510.000 | 36,080,000 | |
| シキボウ | 5,700 | 1,016.000 | 5,791,200 | |
| 日本毛織 | 27,800 | 1,303.000 | 36,223,400 | |
| ダイドーリミテッド | 2,700 | 937.000 | 2,529,900 | |
| 帝国繊維 | 12,300 | 2,810.000 | 34,563,000 | |
| 帝人 | 83,300 | 1,372.500 | 114,329,250 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 東レ | 585,200 | 742.100 | 434,276,920 | |
| ダイニック | 3,300 | 752.000 | 2,481,600 | |
| セーレン | 16,000 | 2,683.000 | 42,928,000 | |
| 小松マテーレ | 13,300 | 751.000 | 9,988,300 | |
| ワコールホールディングス | 17,700 | 4,372.000 | 77,384,400 | |
| ホギメディカル | 11,300 | 4,365.000 | 49,324,500 | |
| ＴＳＩホールディングス | 28,800 | 897.000 | 25,833,600 | |
| ワールド | 17,000 | 1,910.000 | 32,470,000 | |
| 三陽商会 | 5,700 | 2,338.000 | 13,326,600 | |
| オンワードホールディングス | 54,600 | 521.000 | 28,446,600 | |
| ルックホールディングス | 3,700 | 2,534.000 | 9,375,800 | |
| ゴールドウイン | 15,500 | 7,963.000 | 123,426,500 | |
| 特種東海製紙 | 4,400 | 3,675.000 | 16,170,000 | |
| 王子ホールディングス | 363,800 | 570.500 | 207,547,900 | |
| 日本製紙 | 49,600 | 900.000 | 44,640,000 | |
| 北越コーポレーション | 44,900 | 1,450.000 | 65,105,000 | |
| 大王製紙 | 40,200 | 860.000 | 34,572,000 | |
| レンゴー | 80,000 | 980.800 | 78,464,000 | |
| トーモク | 5,400 | 2,379.000 | 12,846,600 | |
| ザ・パック | 6,700 | 3,700.000 | 24,790,000 | |
| 北の達人コーポレーション | 41,500 | 164.000 | 6,806,000 | |
| クラレ | 126,800 | 1,954.500 | 247,830,600 | |
| 旭化成 | 593,300 | 1,029.500 | 610,802,350 | |
| レゾナック・ホールディングス | 80,500 | 3,111.000 | 250,435,500 | |
| 住友化学 | 650,400 | 394.000 | 256,257,600 | |
| 住友精化 | 5,400 | 5,280.000 | 28,512,000 | |
| 日産化学 | 41,500 | 4,998.000 | 207,417,000 | |
| ラサ工業 | 3,400 | 2,601.000 | 8,843,400 | |
| クレハ | 19,600 | 2,674.000 | 52,410,400 | |
| 多木化学 | 3,400 | 3,885.000 | 13,209,000 | |
| テイカ | 7,400 | 1,680.000 | 12,432,000 | |
| 石原産業 | 14,800 | 1,440.000 | 21,312,000 | |
| 日本曹達 | 10,100 | 4,830.000 | 48,783,000 | |
| 東ソー | 119,000 | 1,837.500 | 218,662,500 | |
| トクヤマ | 29,000 | 2,680.000 | 77,720,000 | |
| セントラル硝子 | 9,900 | 3,375.000 | 33,412,500 | |
| 東亞合成 | 41,100 | 1,576.500 | 64,794,150 | |
| 大阪ソーダ | 6,200 | 9,000.000 | 55,800,000 | |
| 関東電化工業 | 16,800 | 938.000 | 15,758,400 | |
| デンカ | 34,800 | 2,160.000 | 75,168,000 | |
| 信越化学工業 | 786,700 | 5,638.000 | 4,435,414,600 | |
| 日本カーバイド工業 | 3,800 | 1,640.000 | 6,232,000 | |
| 堺化学工業 | 6,300 | 2,567.000 | 16,172,100 | |
| 第一稀元素化学工業 | 8,000 | 806.000 | 6,448,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| エア・ウォーター | 81,900 | 1,998.000 | 163,636,200 | |
| 日本酸素ホールディングス | 85,300 | 5,200.000 | 443,560,000 | |
| 日本化学工業 | 3,000 | 2,631.000 | 7,893,000 | |
| 日本パーカライジング | 39,000 | 1,205.000 | 46,995,000 | |
| 高圧ガス工業 | 12,600 | 880.000 | 11,088,000 | |
| 四国化成ホールディングス | 11,000 | 1,923.000 | 21,153,000 | |
| ステラ　ケミファ | 4,800 | 4,170.000 | 20,016,000 | |
| 保土谷化学工業 | 2,700 | 4,620.000 | 12,474,000 | |
| 日本触媒 | 50,400 | 1,697.000 | 85,528,800 | |
| 大日精化工業 | 5,800 | 2,974.000 | 17,249,200 | |
| カネカ | 23,400 | 3,710.000 | 86,814,000 | |
| 三菱瓦斯化学 | 63,300 | 2,573.500 | 162,902,550 | |
| 三井化学 | 72,200 | 3,787.000 | 273,421,400 | |
| 東京応化工業 | 42,000 | 3,253.000 | 136,626,000 | |
| 大阪有機化学工業 | 7,700 | 2,946.000 | 22,684,200 | |
| 三菱ケミカルグループ | 640,700 | 902.300 | 578,103,610 | |
| ＫＨネオケム | 13,300 | 1,979.000 | 26,320,700 | |
| ダイセル | 110,600 | 1,271.000 | 140,572,600 | |
| 住友ベークライト | 24,400 | 3,633.000 | 88,645,200 | |
| 積水化学工業 | 174,000 | 2,162.500 | 376,275,000 | |
| 日本ゼオン | 60,200 | 1,293.000 | 77,838,600 | |
| アイカ工業 | 22,000 | 3,326.000 | 73,172,000 | |
| ＵＢＥ | 41,900 | 2,603.000 | 109,065,700 | |
| 積水樹脂 | 13,300 | 2,294.000 | 30,510,200 | |
| 旭有機材 | 5,900 | 3,840.000 | 22,656,000 | |
| ニチバン | 5,100 | 1,928.000 | 9,832,800 | |
| リケンテクノス | 18,200 | 993.000 | 18,072,600 | |
| 大倉工業 | 4,000 | 2,561.000 | 10,244,000 | |
| 積水化成品工業 | 8,700 | 399.000 | 3,471,300 | |
| 群栄化学工業 | 2,100 | 2,686.000 | 5,640,600 | |
| ミライアル | 2,700 | 1,400.000 | 3,780,000 | |
| ダイキョーニシカワ | 18,600 | 653.000 | 12,145,800 | |
| 森六ホールディングス | 4,400 | 2,238.000 | 9,847,200 | |
| 恵和 | 6,300 | 1,006.000 | 6,337,800 | |
| 日本化薬 | 69,000 | 1,279.000 | 88,251,000 | |
| カーリット | 8,700 | 1,058.000 | 9,204,600 | |
| 日本精化 | 6,000 | 2,171.000 | 13,026,000 | |
| 扶桑化学工業 | 9,400 | 3,650.000 | 34,310,000 | |
| トリケミカル研究所 | 10,800 | 3,315.000 | 35,802,000 | |
| ＡＤＥＫＡ | 30,000 | 2,866.500 | 85,995,000 | |
| 日油 | 81,000 | 2,207.000 | 178,767,000 | |
| ハリマ化成グループ | 5,800 | 848.000 | 4,918,400 | |
| 花王 | 213,800 | 6,946.000 | 1,485,054,800 | |
| 第一工業製薬 | 3,600 | 2,960.000 | 10,656,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 石原ケミカル | 4,000 | 2,232.000 | 8,928,000 | |
| 三洋化成工業 | 5,800 | 4,125.000 | 23,925,000 | |
| 大日本塗料 | 9,700 | 1,058.000 | 10,262,600 | |
| 日本ペイントホールディングス | 393,800 | 860.700 | 338,943,660 | |
| 関西ペイント | 78,000 | 2,647.000 | 206,466,000 | |
| 中国塗料 | 18,200 | 1,941.000 | 35,326,200 | |
| 日本特殊塗料 | 5,200 | 1,187.000 | 6,172,400 | |
| 藤倉化成 | 13,700 | 470.000 | 6,439,000 | |
| 太陽ホールディングス | 15,300 | 3,590.000 | 54,927,000 | |
| ＤＩＣ | 33,200 | 3,034.000 | 100,728,800 | |
| サカタインクス | 21,500 | 1,552.000 | 33,368,000 | |
| ａｒｔｉｅｎｃｅ | 18,500 | 3,800.000 | 70,300,000 | |
| 富士フイルムホールディングス | 488,900 | 3,822.000 | 1,868,575,800 | |
| 資生堂 | 183,800 | 3,338.000 | 613,524,400 | |
| ライオン | 112,300 | 1,539.000 | 172,829,700 | |
| 高砂香料工業 | 6,800 | 5,270.000 | 35,836,000 | |
| マンダム | 21,300 | 1,210.000 | 25,773,000 | |
| ミルボン | 14,200 | 2,962.000 | 42,060,400 | |
| コーセー | 18,000 | 8,000.000 | 144,000,000 | |
| コタ | 8,600 | 1,649.000 | 14,181,400 | |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 47,200 | 1,440.500 | 67,991,600 | |
| ノエビアホールディングス | 8,200 | 5,340.000 | 43,788,000 | |
| 新日本製薬 | 5,000 | 1,803.000 | 9,015,000 | |
| Ｉ－ｎｅ | 3,200 | 1,834.000 | 5,868,800 | |
| アクシージア | 6,300 | 581.000 | 3,660,300 | |
| エステー | 6,700 | 1,492.000 | 9,996,400 | |
| アグロ　カネショウ | 4,400 | 1,280.000 | 5,632,000 | |
| コニシ | 25,100 | 1,261.000 | 31,651,100 | |
| 長谷川香料 | 18,400 | 2,963.000 | 54,519,200 | |
| 小林製薬 | 23,800 | 5,418.000 | 128,948,400 | |
| 荒川化学工業 | 7,700 | 1,204.000 | 9,270,800 | |
| メック | 7,600 | 3,620.000 | 27,512,000 | |
| 日本高純度化学 | 2,300 | 3,030.000 | 6,969,000 | |
| タカラバイオ | 25,600 | 1,019.000 | 26,086,400 | |
| ＪＣＵ | 9,700 | 3,390.000 | 32,883,000 | |
| 新田ゼラチン | 6,000 | 888.000 | 5,328,000 | |
| ＯＡＴアグリオ | 3,300 | 1,859.000 | 6,134,700 | |
| デクセリアルズ | 21,700 | 5,828.000 | 126,467,600 | |
| アース製薬 | 8,500 | 5,260.000 | 44,710,000 | |
| 北興化学工業 | 9,600 | 1,287.000 | 12,355,200 | |
| 大成ラミック | 3,500 | 2,665.000 | 9,327,500 | |
| クミアイ化学工業 | 34,600 | 787.000 | 27,230,200 | |
| 日本農薬 | 16,300 | 591.000 | 9,633,300 | |
| アキレス | 5,700 | 1,544.000 | 8,800,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 有沢製作所 | 15,900 | 1,436.000 | 22,832,400 | |
| 日東電工 | 55,500 | 11,510.000 | 638,805,000 | |
| レック | 12,300 | 1,262.000 | 15,522,600 | |
| 三光合成 | 11,700 | 538.000 | 6,294,600 | |
| きもと | 21,600 | 234.000 | 5,054,400 | |
| 藤森工業 | 6,900 | 4,250.000 | 29,325,000 | |
| 前澤化成工業 | 6,000 | 1,733.000 | 10,398,000 | |
| 未来工業 | 3,300 | 3,340.000 | 11,022,000 | |
| ＪＳＰ | 6,000 | 1,918.000 | 11,508,000 | |
| エフピコ | 17,200 | 2,886.500 | 49,647,800 | |
| 天馬 | 6,100 | 2,520.000 | 15,372,000 | |
| 信越ポリマー | 19,000 | 1,488.000 | 28,272,000 | |
| 東リ | 18,200 | 372.000 | 6,770,400 | |
| ニフコ | 26,000 | 3,563.000 | 92,638,000 | |
| バルカー | 7,500 | 3,285.000 | 24,637,500 | |
| ユニ・チャーム | 183,400 | 5,080.000 | 931,672,000 | |
| 協和キリン | 106,200 | 3,267.000 | 346,955,400 | |
| 武田薬品工業 | 777,400 | 4,209.000 | 3,272,076,600 | |
| アステラス製薬 | 770,300 | 1,689.000 | 1,301,036,700 | |
| 塩野義製薬 | 106,800 | 6,355.000 | 678,714,000 | |
| わかもと製薬 | 9,000 | 240.000 | 2,160,000 | |
| 日本新薬 | 23,000 | 3,340.000 | 76,820,000 | |
| 中外製薬 | 275,100 | 6,867.000 | 1,889,111,700 | |
| 科研製薬 | 14,400 | 3,923.000 | 56,491,200 | |
| エーザイ | 107,000 | 5,672.000 | 606,904,000 | |
| ロート製薬 | 85,100 | 3,559.000 | 302,870,900 | |
| 小野薬品工業 | 179,100 | 1,908.500 | 341,812,350 | |
| 久光製薬 | 19,900 | 3,939.000 | 78,386,100 | |
| 持田製薬 | 11,300 | 3,220.000 | 36,386,000 | |
| 参天製薬 | 154,600 | 1,779.000 | 275,033,400 | |
| 扶桑薬品工業 | 4,500 | 2,171.000 | 9,769,500 | |
| ツムラ | 27,700 | 3,866.000 | 107,088,200 | |
| キッセイ薬品工業 | 15,500 | 3,440.000 | 53,320,000 | |
| 生化学工業 | 19,000 | 791.000 | 15,029,000 | |
| 栄研化学 | 17,300 | 2,345.000 | 40,568,500 | |
| 鳥居薬品 | 5,300 | 3,725.000 | 19,742,500 | |
| ＪＣＲファーマ | 31,800 | 653.000 | 20,765,400 | |
| 東和薬品 | 14,500 | 2,927.000 | 42,441,500 | |
| 富士製薬工業 | 7,900 | 1,228.000 | 9,701,200 | |
| ゼリア新薬工業 | 13,500 | 2,214.000 | 29,889,000 | |
| ネクセラファーマ | 40,500 | 1,265.000 | 51,232,500 | |
| 第一三共 | 765,000 | 4,968.000 | 3,800,520,000 | |
| 杏林製薬 | 21,900 | 1,506.000 | 32,981,400 | |
| 大幸薬品 | 24,400 | 397.000 | 9,686,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ダイト | 8,000 | 2,214.000 | 17,712,000 | |
| 大塚ホールディングス | 219,100 | 8,044.000 | 1,762,440,400 | |
| ペプチドリーム | 43,000 | 2,400.000 | 103,200,000 | |
| セルソース | 8,600 | 1,237.000 | 10,638,200 | |
| あすか製薬ホールディングス | 9,900 | 2,156.000 | 21,344,400 | |
| サワイグループホールディングス | 20,000 | 5,994.000 | 119,880,000 | |
| 日本コークス工業 | 95,100 | 96.000 | 9,129,600 | |
| ニチレキ | 11,800 | 2,569.000 | 30,314,200 | |
| ユシロ化学工業 | 4,500 | 1,526.000 | 6,867,000 | |
| 富士石油 | 26,200 | 356.000 | 9,327,200 | |
| 出光興産 | 455,700 | 987.800 | 450,140,460 | |
| ＥＮＥＯＳホールディングス | 1,387,000 | 738.000 | 1,023,606,000 | |
| コスモエネルギーホールディングス | 26,100 | 7,581.000 | 197,864,100 | |
| 横浜ゴム | 44,100 | 3,034.000 | 133,799,400 | |
| ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ | 49,700 | 1,963.500 | 97,585,950 | |
| ブリヂストン | 257,000 | 5,280.000 | 1,356,960,000 | |
| 住友ゴム工業 | 85,100 | 1,497.000 | 127,394,700 | |
| 藤倉コンポジット | 7,100 | 1,211.000 | 8,598,100 | |
| オカモト | 4,100 | 5,210.000 | 21,361,000 | |
| フコク | 5,000 | 1,652.000 | 8,260,000 | |
| ニッタ | 9,100 | 3,610.000 | 32,851,000 | |
| 住友理工 | 14,000 | 1,448.000 | 20,272,000 | |
| 三ツ星ベルト | 10,500 | 3,945.000 | 41,422,500 | |
| バンドー化学 | 12,700 | 1,813.000 | 23,025,100 | |
| 日東紡績 | 11,200 | 5,540.000 | 62,048,000 | |
| ＡＧＣ | 85,400 | 4,321.000 | 369,013,400 | |
| 日本山村硝子 | 2,700 | 1,461.000 | 3,944,700 | |
| 日本電気硝子 | 35,000 | 3,222.000 | 112,770,000 | |
| オハラ | 5,300 | 1,375.000 | 7,287,500 | |
| 住友大阪セメント | 14,600 | 3,864.000 | 56,414,400 | |
| 太平洋セメント | 51,300 | 3,112.000 | 159,645,600 | |
| 日本ヒューム | 8,400 | 1,269.000 | 10,659,600 | |
| 日本コンクリート工業 | 19,100 | 342.000 | 6,532,200 | |
| 三谷セキサン | 4,000 | 5,620.000 | 22,480,000 | |
| アジアパイルホールディングス | 13,500 | 816.000 | 11,016,000 | |
| 東海カーボン | 78,700 | 827.000 | 65,084,900 | |
| 日本カーボン | 4,700 | 4,250.000 | 19,975,000 | |
| 東洋炭素 | 6,100 | 5,110.000 | 31,171,000 | |
| ノリタケ | 9,600 | 3,700.000 | 35,520,000 | |
| ＴＯＴＯ | 58,100 | 4,750.000 | 275,975,000 | |
| 日本碍子 | 100,700 | 1,828.500 | 184,129,950 | |
| 日本特殊陶業 | 72,900 | 3,926.000 | 286,205,400 | |
| ダントーホールディングス | 3,600 | 378.000 | 1,360,800 | |
| ＭＡＲＵＷＡ | 3,200 | 36,100.000 | 115,520,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 品川リフラクトリーズ | 10,700 | 1,659.000 | 17,751,300 | |
| 黒崎播磨 | 7,200 | 2,090.000 | 15,048,000 | |
| ヨータイ | 5,000 | 1,725.000 | 8,625,000 | |
| 東京窯業 | 10,700 | 406.000 | 4,344,200 | |
| フジミインコーポレーテッド | 23,800 | 2,217.000 | 52,764,600 | |
| ニチアス | 21,800 | 5,090.000 | 110,962,000 | |
| ニチハ | 10,900 | 3,480.000 | 37,932,000 | |
| 日本製鉄 | 420,200 | 2,998.000 | 1,259,759,600 | |
| 神戸製鋼所 | 179,900 | 1,657.500 | 298,184,250 | |
| 中山製鋼所 | 19,400 | 771.000 | 14,957,400 | |
| 合同製鐵 | 4,700 | 4,175.000 | 19,622,500 | |
| ＪＦＥホールディングス | 250,500 | 1,848.000 | 462,924,000 | |
| 東京製鐵 | 25,500 | 1,981.000 | 50,515,500 | |
| 共英製鋼 | 9,600 | 1,671.000 | 16,041,600 | |
| 大和工業 | 16,800 | 7,021.000 | 117,952,800 | |
| 東京鐵鋼 | 4,000 | 5,040.000 | 20,160,000 | |
| 大阪製鐵 | 5,300 | 3,340.000 | 17,702,000 | |
| 淀川製鋼所 | 9,800 | 5,440.000 | 53,312,000 | |
| 中部鋼鈑 | 6,500 | 2,329.000 | 15,138,500 | |
| 丸一鋼管 | 27,300 | 3,294.000 | 89,926,200 | |
| モリ工業 | 2,000 | 5,330.000 | 10,660,000 | |
| 大同特殊鋼 | 56,000 | 1,359.000 | 76,104,000 | |
| 日本冶金工業 | 6,300 | 4,405.000 | 27,751,500 | |
| 山陽特殊製鋼 | 9,000 | 1,840.000 | 16,560,000 | |
| 愛知製鋼 | 5,100 | 3,480.000 | 17,748,000 | |
| 日本金属 | 3,600 | 653.000 | 2,350,800 | |
| 大平洋金属 | 8,100 | 1,310.000 | 10,611,000 | |
| 新日本電工 | 48,000 | 294.000 | 14,112,000 | |
| 栗本鐵工所 | 4,500 | 4,135.000 | 18,607,500 | |
| 三菱製鋼 | 6,400 | 1,302.000 | 8,332,800 | |
| 日本精線 | 7,300 | 1,074.000 | 7,840,200 | |
| エンビプロ・ホールディングス | 8,400 | 493.000 | 4,141,200 | |
| 新家工業 | 1,900 | 4,875.000 | 9,262,500 | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 12,200 | 1,062.000 | 12,956,400 | |
| 日本軽金属ホールディングス | 25,900 | 1,567.000 | 40,585,300 | |
| 三井金属鉱業 | 26,200 | 4,438.000 | 116,275,600 | |
| 三菱マテリアル | 64,600 | 2,371.000 | 153,166,600 | |
| 住友金属鉱山 | 105,200 | 3,642.000 | 383,138,400 | |
| ＤＯＷＡホールディングス | 22,400 | 4,799.000 | 107,497,600 | |
| 古河機械金属 | 12,900 | 1,551.000 | 20,007,900 | |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 16,100 | 2,275.000 | 36,627,500 | |
| 東邦チタニウム | 19,600 | 1,019.000 | 19,972,400 | |
| ＵＡＣＪ | 12,800 | 5,090.000 | 65,152,000 | |
| ＣＫサンエツ | 2,300 | 3,340.000 | 7,682,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 古河電気工業 | 30,300 | 3,144.000 | 95,263,200 | |
| 住友電気工業 | 338,400 | 2,256.000 | 763,430,400 | |
| フジクラ | 106,800 | 4,136.000 | 441,724,800 | |
| ＳＷＣＣ | 10,400 | 5,130.000 | 53,352,000 | |
| 平河ヒューテック | 6,300 | 1,431.000 | 9,015,300 | |
| リョービ | 9,700 | 1,918.000 | 18,604,600 | |
| アーレスティ | 7,100 | 583.000 | 4,139,300 | |
| ＡＲＥホールディングス | 34,300 | 1,788.000 | 61,328,400 | |
| 稲葉製作所 | 6,200 | 1,759.000 | 10,905,800 | |
| 宮地エンジニアリンググループ | 5,200 | 4,135.000 | 21,502,000 | |
| トーカロ | 26,400 | 1,721.000 | 45,434,400 | |
| アルファ | 3,900 | 1,181.000 | 4,605,900 | |
| ＳＵＭＣＯ | 171,700 | 1,397.000 | 239,864,900 | |
| 川田テクノロジーズ | 6,900 | 2,515.000 | 17,353,500 | |
| ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ | 6,500 | 3,475.000 | 22,587,500 | |
| ジェイテックコーポレーション | 1,600 | 1,543.000 | 2,468,800 | |
| 信和 | 7,900 | 764.000 | 6,035,600 | |
| 東洋製罐グループホールディングス | 51,700 | 2,285.500 | 118,160,350 | |
| ホッカンホールディングス | 5,100 | 1,660.000 | 8,466,000 | |
| 横河ブリッジホールディングス | 14,300 | 2,629.000 | 37,594,700 | |
| 駒井ハルテック | 800 | 1,629.000 | 1,303,200 | |
| 三和ホールディングス | 89,700 | 3,394.000 | 304,441,800 | |
| 文化シヤッター | 24,300 | 1,631.000 | 39,633,300 | |
| 三協立山 | 11,300 | 727.000 | 8,215,100 | |
| アルインコ | 7,700 | 968.000 | 7,453,600 | |
| ＬＩＸＩＬ | 140,400 | 1,726.000 | 242,330,400 | |
| ノーリツ | 15,200 | 1,870.000 | 28,424,000 | |
| 長府製作所 | 9,600 | 2,005.000 | 19,248,000 | |
| リンナイ | 42,900 | 3,411.000 | 146,331,900 | |
| 日東精工 | 13,700 | 538.000 | 7,370,600 | |
| 岡部 | 16,300 | 743.000 | 12,110,900 | |
| ジーテクト | 10,800 | 1,544.000 | 16,675,200 | |
| 東プレ | 15,300 | 1,742.000 | 26,652,600 | |
| 高周波熱錬 | 14,700 | 1,000.000 | 14,700,000 | |
| 東京製綱 | 5,800 | 1,045.000 | 6,061,000 | |
| パイオラックス | 12,000 | 2,296.000 | 27,552,000 | |
| エイチワン | 9,600 | 900.000 | 8,640,000 | |
| 日本発条 | 79,400 | 1,770.000 | 140,538,000 | |
| 中央発條 | 5,400 | 1,156.000 | 6,242,400 | |
| 立川ブラインド工業 | 4,400 | 1,262.000 | 5,552,800 | |
| 日本製鋼所 | 24,300 | 4,149.000 | 100,820,700 | |
| 三浦工業 | 37,100 | 3,437.000 | 127,512,700 | |
| タクマ | 29,500 | 1,541.000 | 45,459,500 | |
| ツガミ | 18,700 | 1,344.000 | 25,132,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| オークマ | 7,800 | 5,664.000 | 44,179,200 | |
| 芝浦機械 | 8,500 | 3,625.000 | 30,812,500 | |
| アマダ | 134,800 | 1,428.000 | 192,494,400 | |
| アイダエンジニアリング | 18,000 | 768.000 | 13,824,000 | |
| ＦＵＪＩ | 40,800 | 2,204.000 | 89,923,200 | |
| 牧野フライス製作所 | 9,500 | 5,540.000 | 52,630,000 | |
| オーエスジー | 38,500 | 1,932.500 | 74,401,250 | |
| 旭ダイヤモンド工業 | 21,200 | 832.000 | 17,638,400 | |
| ＤＭＧ森精機 | 55,500 | 3,063.000 | 169,996,500 | |
| ソディック | 22,400 | 728.000 | 16,307,200 | |
| ディスコ | 42,600 | 33,710.000 | 1,436,046,000 | |
| 日東工器 | 4,300 | 2,301.000 | 9,894,300 | |
| 日進工具 | 7,100 | 748.000 | 5,310,800 | |
| 冨士ダイス | 5,800 | 754.000 | 4,373,200 | |
| 豊和工業 | 5,500 | 814.000 | 4,477,000 | |
| 石川製作所 | 3,100 | 1,384.000 | 4,290,400 | |
| リケンＮＰＲ | 9,200 | 2,296.000 | 21,123,200 | |
| 島精機製作所 | 13,500 | 1,292.000 | 17,442,000 | |
| オプトラン | 14,500 | 1,686.000 | 24,447,000 | |
| イワキ | 6,100 | 2,654.000 | 16,189,400 | |
| フリュー | 9,200 | 1,058.000 | 9,733,600 | |
| ヤマシンフィルタ | 21,800 | 444.000 | 9,679,200 | |
| 日阪製作所 | 8,800 | 1,117.000 | 9,829,600 | |
| やまびこ | 13,900 | 2,238.000 | 31,108,200 | |
| 野村マイクロ・サイエンス | 12,000 | 2,282.000 | 27,384,000 | |
| 平田機工 | 4,000 | 4,680.000 | 18,720,000 | |
| ＰＥＧＡＳＵＳ | 11,000 | 487.000 | 5,357,000 | |
| マルマエ | 4,300 | 1,521.000 | 6,540,300 | |
| タツモ | 6,400 | 2,514.000 | 16,089,600 | |
| ナブテスコ | 55,700 | 2,293.000 | 127,720,100 | |
| 三井海洋開発 | 11,200 | 2,736.000 | 30,643,200 | |
| レオン自動機 | 9,900 | 1,348.000 | 13,345,200 | |
| ＳＭＣ | 26,500 | 58,630.000 | 1,553,695,000 | |
| ホソカワミクロン | 6,000 | 4,055.000 | 24,330,000 | |
| ユニオンツール | 3,800 | 5,620.000 | 21,356,000 | |
| 瑞光 | 7,300 | 1,230.000 | 8,979,000 | |
| オイレス工業 | 11,100 | 2,011.000 | 22,322,100 | |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 3,400 | 4,675.000 | 15,895,000 | |
| サトーホールディングス | 11,600 | 1,948.000 | 22,596,800 | |
| 技研製作所 | 8,100 | 1,731.000 | 14,021,100 | |
| 日本エアーテック | 5,400 | 1,136.000 | 6,134,400 | |
| 日精樹脂工業 | 6,400 | 921.000 | 5,894,400 | |
| ワイエイシイホールディングス | 3,900 | 1,998.000 | 7,792,200 | |
| 小松製作所 | 414,500 | 3,661.000 | 1,517,484,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 住友重機械工業 | 51,500 | 3,200.000 | 164,800,000 | |
| 日立建機 | 35,000 | 3,338.000 | 116,830,000 | |
| 日工 | 11,000 | 675.000 | 7,425,000 | |
| 巴工業 | 3,700 | 3,980.000 | 14,726,000 | |
| 井関農機 | 8,400 | 969.000 | 8,139,600 | |
| ＴＯＷＡ | 9,900 | 5,780.000 | 57,222,000 | |
| ローツェ | 46,000 | 1,805.000 | 83,030,000 | |
| クボタ | 462,400 | 1,921.500 | 888,501,600 | |
| 荏原実業 | 4,400 | 3,900.000 | 17,160,000 | |
| 三菱化工機 | 3,000 | 3,445.000 | 10,335,000 | |
| 月島ホールディングス | 11,500 | 1,298.000 | 14,927,000 | |
| 帝国電機製作所 | 5,900 | 2,648.000 | 15,623,200 | |
| 新東工業 | 16,700 | 973.000 | 16,249,100 | |
| 澁谷工業 | 8,100 | 3,510.000 | 28,431,000 | |
| アイチコーポレーション | 12,200 | 1,152.000 | 14,054,400 | |
| 小森コーポレーション | 21,300 | 1,121.000 | 23,877,300 | |
| 鶴見製作所 | 7,500 | 3,715.000 | 27,862,500 | |
| 酒井重工業 | 1,400 | 4,550.000 | 6,370,000 | |
| 荏原製作所 | 181,300 | 1,940.000 | 351,722,000 | |
| 酉島製作所 | 7,600 | 2,570.000 | 19,532,000 | |
| 北越工業 | 9,000 | 1,778.000 | 16,002,000 | |
| ダイキン工業 | 105,600 | 17,505.000 | 1,848,528,000 | |
| オルガノ | 10,600 | 6,600.000 | 69,960,000 | |
| トーヨーカネツ | 2,900 | 3,950.000 | 11,455,000 | |
| 栗田工業 | 49,900 | 5,431.000 | 271,006,900 | |
| 椿本チエイン | 11,800 | 5,670.000 | 66,906,000 | |
| 大同工業 | 6,300 | 789.000 | 4,970,700 | |
| 木村化工機 | 8,700 | 693.000 | 6,029,100 | |
| アネスト岩田 | 13,200 | 1,283.000 | 16,935,600 | |
| ダイフク | 149,200 | 2,625.500 | 391,724,600 | |
| サムコ | 2,300 | 3,350.000 | 7,705,000 | |
| 加藤製作所 | 3,200 | 1,177.000 | 3,766,400 | |
| タダノ | 50,200 | 909.600 | 45,661,920 | |
| フジテック | 20,800 | 4,711.000 | 97,988,800 | |
| ＣＫＤ | 24,300 | 2,733.000 | 66,411,900 | |
| 平和 | 26,700 | 2,106.000 | 56,230,200 | |
| 理想科学工業 | 7,400 | 3,445.000 | 25,493,000 | |
| ＳＡＮＫＹＯ | 88,000 | 2,147.500 | 188,980,000 | |
| 日本金銭機械 | 10,800 | 911.000 | 9,838,800 | |
| マースグループホールディングス | 4,800 | 3,460.000 | 16,608,000 | |
| フクシマガリレイ | 5,900 | 5,340.000 | 31,506,000 | |
| ダイコク電機 | 4,600 | 3,405.000 | 15,663,000 | |
| 竹内製作所 | 15,600 | 4,160.000 | 64,896,000 | |
| アマノ | 25,100 | 4,175.000 | 104,792,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ジャノメ | 9,400 | 817.000 | 7,679,800 | |
| マックス | 12,000 | 3,465.000 | 41,580,000 | |
| グローリー | 20,700 | 2,562.000 | 53,033,400 | |
| 新晃工業 | 8,800 | 4,605.000 | 40,524,000 | |
| 大和冷機工業 | 13,500 | 1,460.000 | 19,710,000 | |
| セガサミーホールディングス | 79,100 | 2,900.000 | 229,390,000 | |
| ＴＰＲ | 10,000 | 2,203.000 | 22,030,000 | |
| ツバキ・ナカシマ | 19,300 | 676.000 | 13,046,800 | |
| ホシザキ | 58,200 | 4,704.000 | 273,772,800 | |
| 大豊工業 | 9,000 | 596.000 | 5,364,000 | |
| 日本精工 | 161,100 | 697.600 | 112,383,360 | |
| ＮＴＮ | 185,600 | 248.600 | 46,140,160 | |
| ジェイテクト | 77,000 | 1,049.500 | 80,811,500 | |
| 不二越 | 6,300 | 2,999.000 | 18,893,700 | |
| 日本トムソン | 21,800 | 463.000 | 10,093,400 | |
| ＴＨＫ | 50,700 | 2,400.000 | 121,680,000 | |
| ユーシン精機 | 7,900 | 631.000 | 4,984,900 | |
| 前澤給装工業 | 6,900 | 1,327.000 | 9,156,300 | |
| イーグル工業 | 9,500 | 2,045.000 | 19,427,500 | |
| 前澤工業 | 4,900 | 1,212.000 | 5,938,800 | |
| ＰＩＬＬＡＲ | 7,900 | 3,920.000 | 30,968,000 | |
| キッツ | 29,500 | 1,012.000 | 29,854,000 | |
| マキタ | 101,000 | 4,630.000 | 467,630,000 | |
| 三井Ｅ＆Ｓ | 43,700 | 1,105.000 | 48,288,500 | |
| 日立造船 | 77,500 | 953.000 | 73,857,500 | |
| 三菱重工業 | 1,546,700 | 1,825.500 | 2,823,500,850 | |
| ＩＨＩ | 66,800 | 6,754.000 | 451,167,200 | |
| スター精密 | 15,300 | 1,856.000 | 28,396,800 | |
| 日清紡ホールディングス | 65,000 | 903.300 | 58,714,500 | |
| イビデン | 46,300 | 4,370.000 | 202,331,000 | |
| コニカミノルタ | 197,300 | 402.700 | 79,452,710 | |
| ブラザー工業 | 117,800 | 2,769.500 | 326,247,100 | |
| ミネベアミツミ | 153,900 | 2,576.500 | 396,523,350 | |
| 日立製作所 | 2,125,600 | 3,410.000 | 7,248,296,000 | |
| 三菱電機 | 969,400 | 2,302.500 | 2,232,043,500 | |
| 富士電機 | 53,800 | 7,807.000 | 420,016,600 | |
| 東洋電機製造 | 5,000 | 1,084.000 | 5,420,000 | |
| 安川電機 | 96,100 | 4,381.000 | 421,014,100 | |
| シンフォニア　テクノロジー | 10,000 | 4,590.000 | 45,900,000 | |
| 明電舎 | 16,400 | 3,070.000 | 50,348,000 | |
| オリジン | 3,500 | 1,187.000 | 4,154,500 | |
| 山洋電気 | 3,600 | 9,410.000 | 33,876,000 | |
| デンヨー | 6,900 | 2,399.000 | 16,553,100 | |
| ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ | 46,400 | 3,105.000 | 144,072,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ソシオネクスト | 64,600 | 2,781.000 | 179,652,600 | |
| 東芝テック | 11,400 | 3,350.000 | 38,190,000 | |
| 芝浦メカトロニクス | 5,000 | 7,480.000 | 37,400,000 | |
| マブチモーター | 42,100 | 2,135.500 | 89,904,550 | |
| ニデック | 195,500 | 5,587.000 | 1,092,258,500 | |
| トレックス・セミコンダクター | 4,800 | 1,501.000 | 7,204,800 | |
| 東光高岳 | 5,300 | 1,727.000 | 9,153,100 | |
| ダイヘン | 8,300 | 6,310.000 | 52,373,000 | |
| ヤーマン | 17,100 | 823.000 | 14,073,300 | |
| ＪＶＣケンウッド | 69,900 | 1,316.000 | 91,988,400 | |
| ミマキエンジニアリング | 9,000 | 1,378.000 | 12,402,000 | |
| Ｉ－ＰＥＸ | 6,200 | 1,493.000 | 9,256,600 | |
| 大崎電気工業 | 21,000 | 727.000 | 15,267,000 | |
| オムロン | 67,700 | 5,980.000 | 404,846,000 | |
| 日東工業 | 11,400 | 3,005.000 | 34,257,000 | |
| ＩＤＥＣ | 12,700 | 2,538.000 | 32,232,600 | |
| ジーエス・ユアサ　コーポレーション | 34,200 | 2,881.000 | 98,530,200 | |
| サクサ | 1,700 | 2,291.000 | 3,894,700 | |
| メルコホールディングス | 3,300 | 3,805.000 | 12,556,500 | |
| 日本電気 | 116,200 | 13,305.000 | 1,546,041,000 | |
| 富士通 | 814,300 | 2,931.500 | 2,387,120,450 | |
| 沖電気工業 | 39,200 | 945.000 | 37,044,000 | |
| 電気興業 | 3,700 | 1,954.000 | 7,229,800 | |
| サンケン電気 | 8,300 | 6,045.000 | 50,173,500 | |
| アイホン | 4,900 | 2,840.000 | 13,916,000 | |
| ルネサスエレクトロニクス | 674,200 | 2,023.500 | 1,364,243,700 | |
| セイコーエプソン | 113,200 | 2,565.500 | 290,414,600 | |
| ワコム | 64,900 | 632.000 | 41,016,800 | |
| アルバック | 19,400 | 7,198.000 | 139,641,200 | |
| アクセル | 4,400 | 1,331.000 | 5,856,400 | |
| ＥＩＺＯ | 6,300 | 4,335.000 | 27,310,500 | |
| 日本信号 | 19,000 | 947.000 | 17,993,000 | |
| 京三製作所 | 19,500 | 501.000 | 9,769,500 | |
| 能美防災 | 12,200 | 2,643.000 | 32,244,600 | |
| ホーチキ | 7,400 | 1,921.000 | 14,215,400 | |
| エレコム | 21,200 | 1,418.000 | 30,061,600 | |
| パナソニック　ホールディングス | 1,044,400 | 1,201.500 | 1,254,846,600 | |
| シャープ | 147,000 | 920.800 | 135,357,600 | |
| アンリツ | 62,200 | 1,074.500 | 66,833,900 | |
| 富士通ゼネラル | 25,300 | 2,027.500 | 51,295,750 | |
| ソニーグループ | 613,400 | 12,805.000 | 7,854,587,000 | |
| ＴＤＫ | 140,100 | 8,514.000 | 1,192,811,400 | |
| 帝国通信工業 | 4,100 | 2,471.000 | 10,131,100 | |
| タムラ製作所 | 36,200 | 587.000 | 21,249,400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| アルプスアルパイン | 79,300 | 1,519.500 | 120,496,350 | |
| 日本電波工業 | 10,800 | 1,031.000 | 11,134,800 | |
| 鈴木 | 5,300 | 1,578.000 | 8,363,400 | |
| メイコー | 8,900 | 5,510.000 | 49,039,000 | |
| 日本トリム | 2,200 | 3,660.000 | 8,052,000 | |
| フォスター電機 | 8,200 | 1,652.000 | 13,546,400 | |
| ＳＭＫ | 2,500 | 2,265.000 | 5,662,500 | |
| ヨコオ | 7,500 | 1,477.000 | 11,077,500 | |
| ホシデン | 19,600 | 2,076.000 | 40,689,600 | |
| ヒロセ電機 | 12,800 | 18,015.000 | 230,592,000 | |
| 日本航空電子工業 | 21,100 | 2,436.000 | 51,399,600 | |
| ＴＯＡ | 10,100 | 942.000 | 9,514,200 | |
| マクセル | 19,000 | 1,744.000 | 33,136,000 | |
| 古野電気 | 11,500 | 1,571.000 | 18,066,500 | |
| スミダコーポレーション | 11,500 | 878.000 | 10,097,000 | |
| アイコム | 3,600 | 2,591.000 | 9,327,600 | |
| リオン | 3,800 | 1,986.000 | 7,546,800 | |
| 横河電機 | 96,800 | 3,543.000 | 342,962,400 | |
| 新電元工業 | 3,400 | 2,317.000 | 7,877,800 | |
| アズビル | 60,200 | 4,626.000 | 278,485,200 | |
| 東亜ディーケーケー | 5,600 | 847.000 | 4,743,200 | |
| 日本光電工業 | 73,800 | 2,063.000 | 152,249,400 | |
| チノー | 3,700 | 2,160.000 | 7,992,000 | |
| 日本電子材料 | 6,500 | 2,330.000 | 15,145,000 | |
| 堀場製作所 | 16,500 | 8,945.000 | 147,592,500 | |
| アドバンテスト | 251,000 | 6,016.000 | 1,510,016,000 | |
| エスペック | 7,100 | 2,364.000 | 16,784,400 | |
| キーエンス | 87,600 | 65,430.000 | 5,731,668,000 | |
| 日置電機 | 4,600 | 7,950.000 | 36,570,000 | |
| シスメックス | 227,100 | 2,821.000 | 640,649,100 | |
| 日本マイクロニクス | 15,600 | 3,545.000 | 55,302,000 | |
| メガチップス | 6,800 | 5,060.000 | 34,408,000 | |
| ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ | 5,900 | 3,875.000 | 22,862,500 | |
| コーセル | 9,800 | 1,026.000 | 10,054,800 | |
| イリソ電子工業 | 7,800 | 2,447.000 | 19,086,600 | |
| オプテックスグループ | 15,600 | 1,621.000 | 25,287,600 | |
| 千代田インテグレ | 3,800 | 3,620.000 | 13,756,000 | |
| レーザーテック | 40,100 | 22,290.000 | 893,829,000 | |
| スタンレー電気 | 56,000 | 2,743.000 | 153,608,000 | |
| ウシオ電機 | 42,300 | 2,042.500 | 86,397,750 | |
| 日本セラミック | 10,000 | 2,490.000 | 24,900,000 | |
| 遠藤照明 | 3,200 | 1,368.000 | 4,377,600 | |
| 山一電機 | 7,700 | 2,319.000 | 17,856,300 | |
| 図研 | 7,400 | 3,435.000 | 25,419,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日本電子 | 21,900 | 5,204.000 | 113,967,600 | |
| カシオ計算機 | 63,200 | 1,141.500 | 72,142,800 | |
| ファナック | 423,900 | 3,778.000 | 1,601,494,200 | |
| 日本シイエムケイ | 19,800 | 382.000 | 7,563,600 | |
| エンプラス | 2,600 | 5,850.000 | 15,210,000 | |
| 大真空 | 12,700 | 579.000 | 7,353,300 | |
| ローム | 158,900 | 1,497.000 | 237,873,300 | |
| 浜松ホトニクス | 70,100 | 3,421.000 | 239,812,100 | |
| 三井ハイテック | 38,800 | 811.000 | 31,466,800 | |
| 新光電気工業 | 29,100 | 5,542.000 | 161,272,200 | |
| 京セラ | 544,100 | 1,668.000 | 907,558,800 | |
| 太陽誘電 | 42,700 | 2,789.500 | 119,111,650 | |
| 村田製作所 | 782,400 | 2,635.000 | 2,061,624,000 | |
| 双葉電子工業 | 17,400 | 500.000 | 8,700,000 | |
| 北陸電気工業 | 3,200 | 1,307.000 | 4,182,400 | |
| ニチコン | 21,200 | 937.000 | 19,864,400 | |
| ＫＯＡ | 12,700 | 1,121.000 | 14,236,700 | |
| 市光工業 | 15,900 | 408.000 | 6,487,200 | |
| 小糸製作所 | 91,100 | 1,962.000 | 178,738,200 | |
| ミツバ | 16,200 | 912.000 | 14,774,400 | |
| ＳＣＲＥＥＮホールディングス | 29,900 | 9,577.000 | 286,352,300 | |
| キヤノン電子 | 9,100 | 2,179.000 | 19,828,900 | |
| キヤノン | 436,900 | 4,723.000 | 2,063,478,700 | |
| リコー | 219,500 | 1,505.000 | 330,347,500 | |
| 象印マホービン | 32,000 | 1,666.000 | 53,312,000 | |
| 東京エレクトロン | 185,300 | 22,440.000 | 4,158,132,000 | |
| イノテック | 6,500 | 1,426.000 | 9,269,000 | |
| トヨタ紡織 | 35,700 | 1,817.000 | 64,866,900 | |
| ユニプレス | 15,100 | 1,076.000 | 16,247,600 | |
| 豊田自動織機 | 75,500 | 10,525.000 | 794,637,500 | |
| モリタホールディングス | 14,600 | 1,978.000 | 28,878,800 | |
| 三櫻工業 | 13,000 | 729.000 | 9,477,000 | |
| デンソー | 720,700 | 2,011.500 | 1,449,688,050 | |
| 東海理化電機製作所 | 25,100 | 1,921.000 | 48,217,100 | |
| 川崎重工業 | 72,100 | 4,933.000 | 355,669,300 | |
| 名村造船所 | 26,100 | 1,398.000 | 36,487,800 | |
| 日本車輌製造 | 3,300 | 2,086.000 | 6,883,800 | |
| 三菱ロジスネクスト | 15,200 | 1,266.000 | 19,243,200 | |
| 日産自動車 | 1,149,100 | 382.700 | 439,760,570 | |
| いすゞ自動車 | 247,700 | 1,988.500 | 492,551,450 | |
| トヨタ自動車 | 4,655,300 | 2,406.000 | 11,200,651,800 | |
| 日野自動車 | 133,400 | 408.900 | 54,547,260 | |
| 三菱自動車工業 | 344,600 | 372.300 | 128,294,580 | |
| 武蔵精密工業 | 22,300 | 1,849.000 | 41,232,700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日産車体 | 6,700 | 995.000 | 6,666,500 | |
| 新明和工業 | 25,900 | 1,262.000 | 32,685,800 | |
| 極東開発工業 | 14,300 | 2,554.000 | 36,522,200 | |
| トピー工業 | 7,100 | 1,970.000 | 13,987,000 | |
| ティラド | 2,400 | 3,520.000 | 8,448,000 | |
| タチエス | 16,300 | 1,858.000 | 30,285,400 | |
| ＮＯＫ | 34,100 | 2,258.000 | 76,997,800 | |
| フタバ産業 | 23,900 | 682.000 | 16,299,800 | |
| カヤバ | 7,900 | 4,640.000 | 36,656,000 | |
| 大同メタル工業 | 19,500 | 474.000 | 9,243,000 | |
| プレス工業 | 36,200 | 571.000 | 20,670,200 | |
| 太平洋工業 | 18,400 | 1,356.000 | 24,950,400 | |
| アイシン | 63,000 | 4,662.000 | 293,706,000 | |
| マツダ | 283,700 | 1,037.000 | 294,196,900 | |
| 今仙電機製作所 | 6,300 | 577.000 | 3,635,100 | |
| 本田技研工業 | 2,072,600 | 1,457.000 | 3,019,778,200 | |
| スズキ | 643,200 | 1,507.000 | 969,302,400 | |
| ＳＵＢＡＲＵ | 270,900 | 2,340.000 | 633,906,000 | |
| 安永 | 4,400 | 597.000 | 2,626,800 | |
| ヤマハ発動機 | 370,700 | 1,238.500 | 459,111,950 | |
| エクセディ | 13,800 | 3,100.000 | 42,780,000 | |
| 豊田合成 | 23,800 | 2,362.000 | 56,215,600 | |
| 愛三工業 | 14,000 | 1,398.000 | 19,572,000 | |
| 日本プラスト | 10,500 | 368.000 | 3,864,000 | |
| ヨロズ | 9,500 | 1,073.000 | 10,193,500 | |
| エフ・シー・シー | 14,200 | 2,360.000 | 33,512,000 | |
| シマノ | 38,300 | 25,085.000 | 960,755,500 | |
| テイ・エス　テック | 32,200 | 1,735.000 | 55,867,000 | |
| ジャムコ | 7,900 | 1,257.000 | 9,930,300 | |
| テルモ | 488,300 | 2,621.500 | 1,280,078,450 | |
| 日機装 | 19,100 | 981.000 | 18,737,100 | |
| 日本エム・ディ・エム | 6,000 | 731.000 | 4,386,000 | |
| 島津製作所 | 116,200 | 4,551.000 | 528,826,200 | |
| 長野計器 | 6,200 | 2,419.000 | 14,997,800 | |
| ブイ・テクノロジー | 4,700 | 2,444.000 | 11,486,800 | |
| 東京計器 | 6,700 | 2,729.000 | 18,284,300 | |
| 愛知時計電機 | 3,800 | 1,974.000 | 7,501,200 | |
| インターアクション | 5,500 | 1,162.000 | 6,391,000 | |
| オーバル | 7,300 | 381.000 | 2,781,300 | |
| 東京精密 | 18,000 | 7,032.000 | 126,576,000 | |
| マニー | 35,200 | 1,800.500 | 63,377,600 | |
| ニコン | 126,100 | 1,430.500 | 180,386,050 | |
| トプコン | 42,800 | 1,445.000 | 61,846,000 | |
| オリンパス | 501,800 | 2,544.000 | 1,276,579,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 理研計器 | 12,700 | 3,945.000 | 50,101,500 | |
| タムロン | 12,000 | 4,360.000 | 52,320,000 | |
| ＨＯＹＡ | 172,400 | 19,170.000 | 3,304,908,000 | |
| ノーリツ鋼機 | 8,200 | 4,040.000 | 33,128,000 | |
| Ａ＆Ｄホロンホールディングス | 12,500 | 2,089.000 | 26,112,500 | |
| 朝日インテック | 106,900 | 2,596.000 | 277,512,400 | |
| シチズン時計 | 78,600 | 900.000 | 70,740,000 | |
| リズム | 1,300 | 3,995.000 | 5,193,500 | |
| メニコン | 30,500 | 1,297.500 | 39,573,750 | |
| 松風 | 4,000 | 4,655.000 | 18,620,000 | |
| セイコーグループ | 12,400 | 3,715.000 | 46,066,000 | |
| ニプロ | 73,300 | 1,342.500 | 98,405,250 | |
| パラマウントベッドホールディングス | 18,900 | 2,483.000 | 46,928,700 | |
| トランザクション | 6,100 | 2,200.000 | 13,420,000 | |
| ニホンフラッシュ | 8,600 | 888.000 | 7,636,800 | |
| 前田工繊 | 15,200 | 1,680.000 | 25,536,000 | |
| 永大産業 | 17,800 | 221.000 | 3,933,800 | |
| アートネイチャー | 9,800 | 821.000 | 8,045,800 | |
| フルヤ金属 | 8,300 | 3,755.000 | 31,166,500 | |
| バンダイナムコホールディングス | 235,400 | 3,221.000 | 758,223,400 | |
| ＳＨＯＥＩ | 24,400 | 2,199.000 | 53,655,600 | |
| フランスベッドホールディングス | 10,500 | 1,215.000 | 12,757,500 | |
| パイロットコーポレーション | 13,500 | 4,376.000 | 59,076,000 | |
| 萩原工業 | 6,300 | 1,429.000 | 9,002,700 | |
| フジシールインターナショナル | 17,400 | 2,314.000 | 40,263,600 | |
| タカラトミー | 39,600 | 3,853.000 | 152,578,800 | |
| 広済堂ホールディングス | 29,800 | 506.000 | 15,078,800 | |
| プロネクサス | 7,800 | 1,250.000 | 9,750,000 | |
| ＴＯＰＰＡＮホールディングス | 104,700 | 4,237.000 | 443,613,900 | |
| 大日本印刷 | 90,900 | 5,031.000 | 457,317,900 | |
| 共同印刷 | 2,800 | 3,360.000 | 9,408,000 | |
| ＮＩＳＳＨＡ | 15,100 | 1,936.000 | 29,233,600 | |
| ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ | 5,300 | 2,741.000 | 14,527,300 | |
| アシックス | 323,400 | 2,728.000 | 882,235,200 | |
| ツツミ | 3,200 | 2,192.000 | 7,014,400 | |
| ローランド | 6,500 | 3,650.000 | 23,725,000 | |
| 小松ウオール工業 | 3,300 | 2,972.000 | 9,807,600 | |
| ヤマハ | 54,000 | 3,514.000 | 189,756,000 | |
| 河合楽器製作所 | 2,900 | 2,778.000 | 8,056,200 | |
| クリナップ | 9,800 | 690.000 | 6,762,000 | |
| ピジョン | 55,700 | 1,524.000 | 84,886,800 | |
| キングジム | 8,800 | 843.000 | 7,418,400 | |
| リンテック | 17,100 | 3,240.000 | 55,404,000 | |
| イトーキ | 17,500 | 1,465.000 | 25,637,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 任天堂 | 553,000 | 7,546.000 | 4,172,938,000 | |
| 三菱鉛筆 | 12,200 | 2,436.000 | 29,719,200 | |
| タカラスタンダード | 17,700 | 1,570.000 | 27,789,000 | |
| コクヨ | 43,200 | 2,493.500 | 107,719,200 | |
| グローブライド | 7,100 | 1,810.000 | 12,851,000 | |
| オカムラ | 25,600 | 2,001.000 | 51,225,600 | |
| 美津濃 | 8,600 | 8,940.000 | 76,884,000 | |
| 東京電力ホールディングス | 790,500 | 633.200 | 500,544,600 | |
| 中部電力 | 321,900 | 1,688.000 | 543,367,200 | |
| 関西電力 | 338,000 | 2,344.000 | 792,272,000 | |
| 中国電力 | 151,400 | 965.200 | 146,131,280 | |
| 北陸電力 | 89,000 | 923.700 | 82,209,300 | |
| 東北電力 | 229,700 | 1,347.000 | 309,405,900 | |
| 四国電力 | 80,400 | 1,282.500 | 103,113,000 | |
| 九州電力 | 201,300 | 1,563.000 | 314,631,900 | |
| 北海道電力 | 84,300 | 955.900 | 80,582,370 | |
| 沖縄電力 | 22,300 | 1,060.000 | 23,638,000 | |
| 電源開発 | 72,100 | 2,365.000 | 170,516,500 | |
| エフオン | 9,900 | 370.000 | 3,663,000 | |
| イーレックス | 17,200 | 697.000 | 11,988,400 | |
| レノバ | 24,800 | 930.000 | 23,064,000 | |
| 東京瓦斯 | 170,800 | 3,364.000 | 574,571,200 | |
| 大阪瓦斯 | 174,800 | 3,336.000 | 583,132,800 | |
| 東邦瓦斯 | 38,200 | 4,096.000 | 156,467,200 | |
| 北海道瓦斯 | 5,100 | 3,060.000 | 15,606,000 | |
| 広島ガス | 20,700 | 386.000 | 7,990,200 | |
| 西部ガスホールディングス | 9,000 | 1,856.000 | 16,704,000 | |
| 静岡ガス | 19,400 | 1,086.000 | 21,068,400 | |
| メタウォーター | 10,900 | 1,694.000 | 18,464,600 | |
| ＳＢＳホールディングス | 9,000 | 2,453.000 | 22,077,000 | |
| 東武鉄道 | 96,000 | 2,590.000 | 248,640,000 | |
| 相鉄ホールディングス | 31,900 | 2,414.000 | 77,006,600 | |
| 東急 | 247,000 | 1,868.500 | 461,519,500 | |
| 京浜急行電鉄 | 109,200 | 1,175.500 | 128,364,600 | |
| 小田急電鉄 | 145,500 | 1,726.000 | 251,133,000 | |
| 京王電鉄 | 42,400 | 3,594.000 | 152,385,600 | |
| 京成電鉄 | 56,800 | 4,524.000 | 256,963,200 | |
| 富士急行 | 12,100 | 2,605.000 | 31,520,500 | |
| 東日本旅客鉄道 | 483,600 | 2,890.000 | 1,397,604,000 | |
| 西日本旅客鉄道 | 208,200 | 2,702.500 | 562,660,500 | |
| 東海旅客鉄道 | 337,900 | 3,341.000 | 1,128,923,900 | |
| 西武ホールディングス | 106,700 | 3,839.000 | 409,621,300 | |
| 鴻池運輸 | 16,800 | 2,363.000 | 39,698,400 | |
| 西日本鉄道 | 23,400 | 2,271.500 | 53,153,100 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ハマキョウレックス | 7,200 | 4,900.000 | 35,280,000 | |
| サカイ引越センター | 11,000 | 2,442.000 | 26,862,000 | |
| 近鉄グループホールディングス | 87,500 | 3,537.000 | 309,487,500 | |
| 阪急阪神ホールディングス | 117,000 | 4,500.000 | 526,500,000 | |
| 南海電気鉄道 | 39,500 | 2,358.500 | 93,160,750 | |
| 京阪ホールディングス | 48,400 | 3,055.000 | 147,862,000 | |
| 神戸電鉄 | 3,000 | 2,605.000 | 7,815,000 | |
| 名古屋鉄道 | 90,700 | 1,715.000 | 155,550,500 | |
| 山陽電気鉄道 | 6,500 | 2,023.000 | 13,149,500 | |
| ヤマトホールディングス | 107,300 | 1,641.500 | 176,132,950 | |
| 山九 | 21,500 | 4,777.000 | 102,705,500 | |
| 丸全昭和運輸 | 5,900 | 4,950.000 | 29,205,000 | |
| センコーグループホールディングス | 46,900 | 1,231.000 | 57,733,900 | |
| トナミホールディングス | 2,000 | 5,660.000 | 11,320,000 | |
| ニッコンホールディングス | 27,200 | 3,755.000 | 102,136,000 | |
| 福山通運 | 9,800 | 3,745.000 | 36,701,000 | |
| セイノーホールディングス | 49,700 | 2,399.500 | 119,255,150 | |
| 神奈川中央交通 | 3,000 | 3,345.000 | 10,035,000 | |
| ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス | 25,600 | 1,103.000 | 28,236,800 | |
| 九州旅客鉄道 | 61,900 | 4,143.000 | 256,451,700 | |
| ＳＧホールディングス | 147,900 | 1,553.000 | 229,688,700 | |
| ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス | 32,600 | 7,156.000 | 233,285,600 | |
| 日本郵船 | 226,100 | 4,836.000 | 1,093,419,600 | |
| 商船三井 | 189,100 | 4,802.000 | 908,058,200 | |
| 川崎汽船 | 210,400 | 1,998.500 | 420,484,400 | |
| ＮＳユナイテッド海運 | 4,800 | 4,290.000 | 20,592,000 | |
| 明海グループ | 7,400 | 713.000 | 5,276,200 | |
| 飯野海運 | 33,200 | 1,181.000 | 39,209,200 | |
| 乾汽船 | 12,600 | 1,138.000 | 14,338,800 | |
| 日本航空 | 213,700 | 2,453.000 | 524,206,100 | |
| ＡＮＡホールディングス | 238,500 | 3,031.000 | 722,893,500 | |
| トランコム | 2,600 | 7,330.000 | 19,058,000 | |
| 日新 | 6,700 | 4,250.000 | 28,475,000 | |
| 三菱倉庫 | 20,500 | 5,232.000 | 107,256,000 | |
| 三井倉庫ホールディングス | 8,100 | 5,990.000 | 48,519,000 | |
| 住友倉庫 | 22,800 | 2,682.000 | 61,149,600 | |
| 澁澤倉庫 | 3,300 | 2,896.000 | 9,556,800 | |
| 東陽倉庫 | 3,700 | 1,321.000 | 4,887,700 | |
| 日本トランスシティ | 17,900 | 894.000 | 16,002,600 | |
| 川西倉庫 | 5,200 | 1,120.000 | 5,824,000 | |
| 安田倉庫 | 6,600 | 1,639.000 | 10,817,400 | |
| 上組 | 40,100 | 3,271.000 | 131,167,100 | |
| キムラユニティー | 4,000 | 1,449.000 | 5,796,000 | |
| キユーソー流通システム | 6,700 | 1,881.000 | 12,602,700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| エーアイテイー | 5,400 | 1,655.000 | 8,937,000 | |
| 内外トランスライン | 3,500 | 2,730.000 | 9,555,000 | |
| 日本コンセプト | 3,300 | 1,632.000 | 5,385,600 | |
| ＮＥＣネッツエスアイ | 33,900 | 2,656.000 | 90,038,400 | |
| クロスキャット | 7,100 | 1,134.000 | 8,051,400 | |
| システナ | 134,900 | 374.000 | 50,452,600 | |
| デジタルアーツ | 5,400 | 4,490.000 | 24,246,000 | |
| 日鉄ソリューションズ | 30,600 | 3,670.000 | 112,302,000 | |
| キューブシステム | 3,500 | 1,027.000 | 3,594,500 | |
| コア | 3,300 | 1,866.000 | 6,157,800 | |
| 手間いらず | 1,900 | 3,400.000 | 6,460,000 | |
| ラクーンホールディングス | 8,100 | 738.000 | 5,977,800 | |
| ソリトンシステムズ | 4,800 | 1,034.000 | 4,963,200 | |
| ソフトクリエイトホールディングス | 7,100 | 1,718.000 | 12,197,800 | |
| ＴＩＳ | 92,700 | 3,574.000 | 331,309,800 | |
| グリー | 30,500 | 436.000 | 13,298,000 | |
| コーエーテクモホールディングス | 55,000 | 1,630.500 | 89,677,500 | |
| 三菱総合研究所 | 3,900 | 4,040.000 | 15,756,000 | |
| ファインデックス | 7,900 | 853.000 | 6,738,700 | |
| ブレインパッド | 7,500 | 823.000 | 6,172,500 | |
| ポールトゥウィンホールディングス | 15,000 | 433.000 | 6,495,000 | |
| ネクソン | 193,100 | 2,697.000 | 520,790,700 | |
| アイスタイル | 29,900 | 516.000 | 15,428,400 | |
| エムアップホールディングス | 11,100 | 1,272.000 | 14,119,200 | |
| エイチーム | 6,700 | 622.000 | 4,167,400 | |
| エニグモ | 12,700 | 328.000 | 4,165,600 | |
| コロプラ | 32,000 | 560.000 | 17,920,000 | |
| ブロードリーフ | 43,900 | 645.000 | 28,315,500 | |
| デジタルハーツホールディングス | 5,700 | 817.000 | 4,656,900 | |
| メディアドゥ | 4,300 | 1,400.000 | 6,020,000 | |
| じげん | 25,500 | 578.000 | 14,739,000 | |
| フィックスターズ | 9,800 | 1,581.000 | 15,493,800 | |
| ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ | 4,600 | 1,361.000 | 6,260,600 | |
| オプティム | 8,500 | 585.000 | 4,972,500 | |
| セレス | 4,000 | 1,246.000 | 4,984,000 | |
| ＳＨＩＦＴ | 5,900 | 12,470.000 | 73,573,000 | |
| ティーガイア | 9,500 | 3,800.000 | 36,100,000 | |
| セック | 1,300 | 4,135.000 | 5,375,500 | |
| テクマトリックス | 16,800 | 2,377.000 | 39,933,600 | |
| プロシップ | 3,900 | 1,501.000 | 5,853,900 | |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 22,800 | 3,003.000 | 68,468,400 | |
| ＧＭＯペイメントゲートウェイ | 20,100 | 9,117.000 | 183,251,700 | |
| システムリサーチ | 5,600 | 1,431.000 | 8,013,600 | |
| インターネットイニシアティブ | 41,900 | 3,018.000 | 126,454,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| さくらインターネット | 11,100 | 4,285.000 | 47,563,500 | |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス | 2,700 | 2,785.000 | 7,519,500 | |
| ＳＲＡホールディングス | 4,200 | 4,200.000 | 17,640,000 | |
| 朝日ネット | 5,600 | 645.000 | 3,612,000 | |
| ｅＢＡＳＥ | 12,200 | 615.000 | 7,503,000 | |
| アバントグループ | 10,700 | 2,193.000 | 23,465,100 | |
| アドソル日進 | 3,500 | 1,723.000 | 6,030,500 | |
| フリービット | 4,600 | 1,235.000 | 5,681,000 | |
| コムチュア | 12,300 | 1,529.000 | 18,806,700 | |
| アイル | 5,400 | 2,778.000 | 15,001,200 | |
| マークラインズ | 5,000 | 2,902.000 | 14,510,000 | |
| メディカル・データ・ビジョン | 12,600 | 503.000 | 6,337,800 | |
| テラスカイ | 4,300 | 2,146.000 | 9,227,800 | |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 4,700 | 2,004.000 | 9,418,800 | |
| ネオジャパン | 3,200 | 1,989.000 | 6,364,800 | |
| ＰＲ　ＴＩＭＥＳ | 2,200 | 1,740.000 | 3,828,000 | |
| ラクス | 41,700 | 2,251.000 | 93,866,700 | |
| ダブルスタンダード | 3,400 | 1,477.000 | 5,021,800 | |
| オープンドア | 6,300 | 697.000 | 4,391,100 | |
| アカツキ | 4,500 | 1,994.000 | 8,973,000 | |
| ＵＢＩＣＯＭホールディングス | 3,100 | 1,411.000 | 4,374,100 | |
| カナミックネットワーク | 12,200 | 534.000 | 6,514,800 | |
| チェンジホールディングス | 19,600 | 1,225.000 | 24,010,000 | |
| シンクロ・フード | 2,300 | 516.000 | 1,186,800 | |
| オークネット | 4,000 | 2,317.000 | 9,268,000 | |
| セグエグループ | 4,500 | 641.000 | 2,884,500 | |
| マクロミル | 17,000 | 785.000 | 13,345,000 | |
| オロ | 3,700 | 2,460.000 | 9,102,000 | |
| ユーザーローカル | 3,800 | 1,866.000 | 7,090,800 | |
| マネーフォワード | 21,600 | 5,764.000 | 124,502,400 | |
| ＳＵＮ　ＡＳＴＥＲＩＳＫ | 6,600 | 537.000 | 3,544,200 | |
| プラスアルファ・コンサルティング | 11,300 | 2,128.000 | 24,046,400 | |
| 電算システムホールディングス | 4,200 | 2,610.000 | 10,962,000 | |
| ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ | 30,100 | 1,729.000 | 52,042,900 | |
| ビジョナル | 10,400 | 8,480.000 | 88,192,000 | |
| プロトコーポレーション | 9,900 | 1,440.000 | 14,256,000 | |
| 野村総合研究所 | 190,300 | 5,101.000 | 970,720,300 | |
| 日本システム技術 | 8,400 | 1,851.000 | 15,548,400 | |
| インテージホールディングス | 10,200 | 1,635.000 | 16,677,000 | |
| 東邦システムサイエンス | 3,800 | 1,488.000 | 5,654,400 | |
| シンプレクス・ホールディングス | 13,500 | 2,364.000 | 31,914,000 | |
| ＨＥＲＯＺ | 4,100 | 1,033.000 | 4,235,300 | |
| ラクスル | 22,000 | 1,130.000 | 24,860,000 | |
| メルカリ | 43,000 | 2,497.500 | 107,392,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ＩＰＳ | 2,900 | 2,199.000 | 6,377,100 | |
| システムサポート | 3,300 | 2,031.000 | 6,702,300 | |
| イーソル | 7,500 | 715.000 | 5,362,500 | |
| ウイングアーク１ｓｔ | 9,500 | 3,005.000 | 28,547,500 | |
| サーバーワークス | 2,100 | 2,751.000 | 5,777,100 | |
| Ｓａｎｓａｎ | 29,100 | 2,277.000 | 66,260,700 | |
| ギフティ | 8,000 | 1,082.000 | 8,656,000 | |
| メドレー | 11,900 | 3,305.000 | 39,329,500 | |
| ベース | 4,300 | 3,185.000 | 13,695,500 | |
| ＪＭＤＣ | 15,200 | 4,650.000 | 70,680,000 | |
| フォーカスシステムズ | 6,000 | 1,103.000 | 6,618,000 | |
| クレスコ | 14,000 | 1,310.000 | 18,340,000 | |
| フジ・メディア・ホールディングス | 83,500 | 1,685.500 | 140,739,250 | |
| オービック | 29,400 | 25,875.000 | 760,725,000 | |
| ジャストシステム | 12,600 | 3,545.000 | 44,667,000 | |
| ＴＤＣソフト | 16,800 | 1,190.000 | 19,992,000 | |
| ＬＩＮＥヤフー | 1,235,900 | 406.000 | 501,775,400 | |
| トレンドマイクロ | 46,200 | 8,865.000 | 409,563,000 | |
| ＩＤホールディングス | 5,900 | 1,375.000 | 8,112,500 | |
| 日本オラクル | 16,600 | 13,895.000 | 230,657,000 | |
| アルファシステムズ | 2,500 | 2,836.000 | 7,090,000 | |
| フューチャー | 21,800 | 1,796.000 | 39,152,800 | |
| ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ | 4,300 | 1,752.000 | 7,533,600 | |
| オービックビジネスコンサルタント | 12,300 | 7,394.000 | 90,946,200 | |
| アイティフォー | 10,900 | 1,374.000 | 14,976,600 | |
| 東計電算 | 2,800 | 4,820.000 | 13,496,000 | |
| 大塚商会 | 99,300 | 3,542.000 | 351,720,600 | |
| サイボウズ | 12,700 | 1,690.000 | 21,463,000 | |
| 電通総研 | 10,000 | 5,470.000 | 54,700,000 | |
| ＡＣＣＥＳＳ | 10,400 | 1,719.000 | 17,877,600 | |
| デジタルガレージ | 14,300 | 2,850.000 | 40,755,000 | |
| イーエムシステムズ | 14,500 | 523.000 | 7,583,500 | |
| ウェザーニューズ | 2,700 | 5,720.000 | 15,444,000 | |
| ＣＩＪ | 23,400 | 424.000 | 9,921,600 | |
| ビジネスエンジニアリング | 1,900 | 3,980.000 | 7,562,000 | |
| WOWOW | 7,000 | 1,046.000 | 7,322,000 | |
| スカラ | 9,000 | 467.000 | 4,203,000 | |
| ＡＮＹＣＯＬＯＲ | 12,700 | 2,390.000 | 30,353,000 | |
| ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ | 8,700 | 479.000 | 4,167,300 | |
| ネットワンシステムズ | 34,800 | 3,612.000 | 125,697,600 | |
| システムソフト | 27,400 | 60.000 | 1,644,000 | |
| アルゴグラフィックス | 8,200 | 5,120.000 | 41,984,000 | |
| マーベラス | 14,200 | 581.000 | 8,250,200 | |
| エイベックス | 15,200 | 1,478.000 | 22,465,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ＢＩＰＲＯＧＹ | 28,700 | 4,884.000 | 140,170,800 | |
| 都築電気 | 4,500 | 2,213.000 | 9,958,500 | |
| ＴＢＳホールディングス | 44,000 | 3,946.000 | 173,624,000 | |
| 日本テレビホールディングス | 77,500 | 2,335.000 | 180,962,500 | |
| 朝日放送グループホールディングス | 9,600 | 638.000 | 6,124,800 | |
| テレビ朝日ホールディングス | 20,800 | 1,971.000 | 40,996,800 | |
| スカパーＪＳＡＴホールディングス | 67,900 | 837.000 | 56,832,300 | |
| テレビ東京ホールディングス | 6,000 | 3,710.000 | 22,260,000 | |
| 日本ＢＳ放送 | 3,500 | 887.000 | 3,104,500 | |
| ビジョン | 13,400 | 1,302.000 | 17,446,800 | |
| Ｕ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ | 10,100 | 5,610.000 | 56,661,000 | |
| 日本通信 | 91,400 | 159.000 | 14,532,600 | |
| 日本電信電話 | 26,116,700 | 148.400 | 3,875,718,280 | |
| ＫＤＤＩ | 645,900 | 4,737.000 | 3,059,628,300 | |
| ソフトバンク | 1,404,200 | 1,988.500 | 2,792,251,700 | |
| 光通信 | 8,700 | 32,160.000 | 279,792,000 | |
| エムティーアイ | 7,400 | 1,139.000 | 8,428,600 | |
| ＧＭＯインターネットグループ | 31,700 | 2,397.500 | 76,000,750 | |
| ファイバーゲート | 5,000 | 1,046.000 | 5,230,000 | |
| ＫＡＤＯＫＡＷＡ | 46,500 | 2,989.000 | 138,988,500 | |
| 学研ホールディングス | 14,600 | 994.000 | 14,512,400 | |
| ゼンリン | 14,500 | 858.000 | 12,441,000 | |
| アイネット | 5,600 | 1,515.000 | 8,484,000 | |
| 松竹 | 4,700 | 10,270.000 | 48,269,000 | |
| 東宝 | 48,800 | 5,845.000 | 285,236,000 | |
| 東映 | 14,500 | 4,515.000 | 65,467,500 | |
| ＮＴＴデータグループ | 230,300 | 2,465.000 | 567,689,500 | |
| ピー・シー・エー | 5,700 | 1,978.000 | 11,274,600 | |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 3,300 | 1,828.000 | 6,032,400 | |
| ＤＴＳ | 17,900 | 3,965.000 | 70,973,500 | |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 40,000 | 5,435.000 | 217,400,000 | |
| シーイーシー | 11,700 | 1,798.000 | 21,036,600 | |
| カプコン | 156,900 | 3,226.000 | 506,159,400 | |
| アイ・エス・ビー | 4,600 | 1,457.000 | 6,702,200 | |
| ＳＣＳＫ | 62,000 | 2,996.000 | 185,752,000 | |
| ＮＳＷ | 3,300 | 2,970.000 | 9,801,000 | |
| アイネス | 6,400 | 1,600.000 | 10,240,000 | |
| ＴＫＣ | 14,900 | 3,805.000 | 56,694,500 | |
| 富士ソフト | 24,100 | 9,350.000 | 225,335,000 | |
| ＮＳＤ | 30,700 | 3,290.000 | 101,003,000 | |
| コナミグループ | 32,900 | 13,840.000 | 455,336,000 | |
| 福井コンピュータホールディングス | 5,200 | 2,471.000 | 12,849,200 | |
| ＪＢＣＣホールディングス | 5,900 | 4,375.000 | 25,812,500 | |
| ミロク情報サービス | 7,900 | 1,837.000 | 14,512,300 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ソフトバンクグループ | 433,300 | 8,168.000 | 3,539,194,400 | |
| リョーサン菱洋ホールディングス | 17,300 | 2,592.000 | 44,841,600 | |
| 高千穂交易 | 3,000 | 3,910.000 | 11,730,000 | |
| 伊藤忠食品 | 2,200 | 7,200.000 | 15,840,000 | |
| エレマテック | 8,000 | 1,714.000 | 13,712,000 | |
| あらた | 14,100 | 3,555.000 | 50,125,500 | |
| トーメンデバイス | 1,400 | 5,530.000 | 7,742,000 | |
| 東京エレクトロン　デバイス | 9,400 | 3,485.000 | 32,759,000 | |
| 円谷フィールズホールディングス | 16,800 | 2,250.000 | 37,800,000 | |
| 双日 | 102,000 | 3,185.000 | 324,870,000 | |
| アルフレッサ　ホールディングス | 93,100 | 2,319.500 | 215,945,450 | |
| 横浜冷凍 | 24,300 | 955.000 | 23,206,500 | |
| ラサ商事 | 5,000 | 1,407.000 | 7,035,000 | |
| アルコニックス | 12,000 | 1,348.000 | 16,176,000 | |
| 神戸物産 | 72,000 | 4,573.000 | 329,256,000 | |
| あい　ホールディングス | 15,000 | 2,342.000 | 35,130,000 | |
| ダイワボウホールディングス | 40,800 | 2,688.500 | 109,690,800 | |
| マクニカホールディングス | 21,700 | 5,620.000 | 121,954,000 | |
| ラクト・ジャパン | 3,900 | 2,909.000 | 11,345,100 | |
| グリムス | 3,900 | 2,599.000 | 10,136,100 | |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 14,200 | 1,203.000 | 17,082,600 | |
| 八洲電機 | 6,900 | 1,575.000 | 10,867,500 | |
| メディアスホールディングス | 7,000 | 782.000 | 5,474,000 | |
| レスター | 8,000 | 2,637.000 | 21,096,000 | |
| ジオリーブグループ | 1,600 | 1,118.000 | 1,788,800 | |
| ＴＯＫＡＩホールディングス | 46,500 | 988.000 | 45,942,000 | |
| 三洋貿易 | 9,900 | 1,455.000 | 14,404,500 | |
| ビューティガレージ | 3,300 | 1,603.000 | 5,289,900 | |
| ウイン・パートナーズ | 5,200 | 1,144.000 | 5,948,800 | |
| シップヘルスケアホールディングス | 33,500 | 2,132.000 | 71,422,000 | |
| スターティアホールディングス | 1,000 | 1,994.000 | 1,994,000 | |
| コメダホールディングス | 22,800 | 2,721.000 | 62,038,800 | |
| フルサト・マルカホールディングス | 8,300 | 2,197.000 | 18,235,100 | |
| ヤマエグループホールディングス | 9,100 | 1,955.000 | 17,790,500 | |
| 小野建 | 8,700 | 1,471.000 | 12,797,700 | |
| 南陽 | 5,000 | 1,067.000 | 5,335,000 | |
| 佐鳥電機 | 6,300 | 1,847.000 | 11,636,100 | |
| エコートレーディング | 2,500 | 930.000 | 2,325,000 | |
| 伯東 | 5,200 | 4,580.000 | 23,816,000 | |
| コンドーテック | 7,000 | 1,213.000 | 8,491,000 | |
| ナガイレーベン | 12,000 | 2,461.000 | 29,532,000 | |
| 三菱食品 | 9,300 | 5,220.000 | 48,546,000 | |
| 松田産業 | 6,800 | 3,085.000 | 20,978,000 | |
| 第一興商 | 34,500 | 1,731.000 | 59,719,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| メディパルホールディングス | 94,000 | 2,590.000 | 243,460,000 | |
| ＳＰＫ | 4,200 | 1,969.000 | 8,269,800 | |
| 萩原電気ホールディングス | 4,300 | 3,440.000 | 14,792,000 | |
| アズワン | 29,000 | 2,800.500 | 81,214,500 | |
| スズデン | 3,800 | 1,793.000 | 6,813,400 | |
| 尾家産業 | 2,500 | 2,016.000 | 5,040,000 | |
| シモジマ | 6,600 | 1,279.000 | 8,441,400 | |
| ドウシシャ | 8,800 | 2,130.000 | 18,744,000 | |
| 高速 | 5,200 | 2,371.000 | 12,329,200 | |
| たけびし | 3,400 | 2,367.000 | 8,047,800 | |
| リックス | 2,300 | 2,826.000 | 6,499,800 | |
| 丸文 | 8,300 | 1,015.000 | 8,424,500 | |
| ハピネット | 9,400 | 3,980.000 | 37,412,000 | |
| 日本ライフライン | 25,900 | 1,178.000 | 30,510,200 | |
| タカショー | 11,900 | 475.000 | 5,652,500 | |
| ＩＤＯＭ | 26,300 | 1,049.000 | 27,588,700 | |
| 進和 | 5,800 | 2,574.000 | 14,929,200 | |
| ダイトロン | 3,600 | 2,592.000 | 9,331,200 | |
| シークス | 12,500 | 1,027.000 | 12,837,500 | |
| オーハシテクニカ | 4,700 | 1,779.000 | 8,361,300 | |
| 白銅 | 2,600 | 2,423.000 | 6,299,800 | |
| 伊藤忠商事 | 622,800 | 7,310.000 | 4,552,668,000 | |
| 丸紅 | 767,500 | 2,208.000 | 1,694,640,000 | |
| 長瀬産業 | 41,100 | 3,141.000 | 129,095,100 | |
| 蝶理 | 5,500 | 3,470.000 | 19,085,000 | |
| 豊田通商 | 242,800 | 2,502.000 | 607,485,600 | |
| 三共生興 | 14,800 | 561.000 | 8,302,800 | |
| 兼松 | 37,100 | 2,394.000 | 88,817,400 | |
| 三井物産 | 1,387,600 | 2,822.500 | 3,916,501,000 | |
| 日本紙パルプ商事 | 4,600 | 6,650.000 | 30,590,000 | |
| カメイ | 9,500 | 1,992.000 | 18,924,000 | |
| スターゼン | 6,200 | 2,939.000 | 18,221,800 | |
| 山善 | 27,200 | 1,346.000 | 36,611,200 | |
| 椿本興業 | 6,000 | 1,747.000 | 10,482,000 | |
| 住友商事 | 559,900 | 3,118.000 | 1,745,768,200 | |
| 内田洋行 | 3,700 | 6,660.000 | 24,642,000 | |
| 三菱商事 | 1,778,800 | 2,824.500 | 5,024,220,600 | |
| 第一実業 | 9,200 | 2,249.000 | 20,690,800 | |
| キヤノンマーケティングジャパン | 21,400 | 4,741.000 | 101,457,400 | |
| 西華産業 | 4,000 | 3,835.000 | 15,340,000 | |
| 佐藤商事 | 6,200 | 1,347.000 | 8,351,400 | |
| 東京産業 | 8,900 | 691.000 | 6,149,900 | |
| ユアサ商事 | 7,300 | 5,020.000 | 36,646,000 | |
| 神鋼商事 | 2,300 | 6,570.000 | 15,111,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 阪和興業 | 16,100 | 4,820.000 | 77,602,000 | |
| 正栄食品工業 | 6,100 | 4,540.000 | 27,694,000 | |
| カナデン | 6,700 | 1,402.000 | 9,393,400 | |
| ＲＹＯＤＥＮ | 7,100 | 2,442.000 | 17,338,200 | |
| 岩谷産業 | 20,900 | 7,852.000 | 164,106,800 | |
| ナイス | 2,600 | 1,864.000 | 4,846,400 | |
| 極東貿易 | 5,400 | 1,476.000 | 7,970,400 | |
| アステナホールディングス | 18,300 | 504.000 | 9,223,200 | |
| 三愛オブリ | 22,200 | 1,944.000 | 43,156,800 | |
| 稲畑産業 | 17,400 | 3,235.000 | 56,289,000 | |
| ＧＳＩクレオス | 5,000 | 1,962.000 | 9,810,000 | |
| 明和産業 | 12,500 | 645.000 | 8,062,500 | |
| ワキタ | 16,100 | 1,591.000 | 25,615,100 | |
| 東邦ホールディングス | 25,100 | 4,759.000 | 119,450,900 | |
| サンゲツ | 21,200 | 2,810.000 | 59,572,000 | |
| ミツウロコグループホールディングス | 12,800 | 1,640.000 | 20,992,000 | |
| シナネンホールディングス | 2,900 | 6,250.000 | 18,125,000 | |
| 伊藤忠エネクス | 22,900 | 1,580.000 | 36,182,000 | |
| サンリオ | 76,200 | 3,755.000 | 286,131,000 | |
| サンワ　テクノス | 4,600 | 1,934.000 | 8,896,400 | |
| 新光商事 | 12,600 | 963.000 | 12,133,800 | |
| トーホー | 4,000 | 2,665.000 | 10,660,000 | |
| 三信電気 | 3,900 | 1,956.000 | 7,628,400 | |
| 東陽テクニカ | 9,100 | 1,669.000 | 15,187,900 | |
| モスフードサービス | 13,300 | 3,485.000 | 46,350,500 | |
| 加賀電子 | 8,000 | 5,340.000 | 42,720,000 | |
| ソーダニッカ | 9,700 | 1,151.000 | 11,164,700 | |
| 立花エレテック | 6,400 | 2,507.000 | 16,044,800 | |
| フォーバル | 1,700 | 1,367.000 | 2,323,900 | |
| ＰＡＬＴＡＣ | 13,100 | 4,237.000 | 55,504,700 | |
| 三谷産業 | 19,000 | 320.000 | 6,080,000 | |
| 太平洋興発 | 3,400 | 735.000 | 2,499,000 | |
| 西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス | 6,900 | 1,332.000 | 9,190,800 | |
| コーア商事ホールディングス | 4,300 | 601.000 | 2,584,300 | |
| ＫＰＰグループホールディングス | 24,800 | 664.000 | 16,467,200 | |
| ヤマタネ | 4,500 | 3,175.000 | 14,287,500 | |
| 泉州電業 | 6,500 | 4,655.000 | 30,257,500 | |
| トラスコ中山 | 18,900 | 2,430.000 | 45,927,000 | |
| オートバックスセブン | 31,900 | 1,469.000 | 46,861,100 | |
| モリト | 7,100 | 1,340.000 | 9,514,000 | |
| 加藤産業 | 11,300 | 4,250.000 | 48,025,000 | |
| イエローハット | 15,000 | 2,397.000 | 35,955,000 | |
| ＪＫホールディングス | 7,800 | 966.000 | 7,534,800 | |
| 日伝 | 6,400 | 3,210.000 | 20,544,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 杉本商事 | 4,300 | 3,085.000 | 13,265,500 | |
| 因幡電機産業 | 23,400 | 3,825.000 | 89,505,000 | |
| 東テク | 9,700 | 2,393.000 | 23,212,100 | |
| ミスミグループ本社 | 140,200 | 2,525.500 | 354,075,100 | |
| タキヒヨー | 3,200 | 1,199.000 | 3,836,800 | |
| スズケン | 34,300 | 5,162.000 | 177,056,600 | |
| ジェコス | 6,100 | 889.000 | 5,422,900 | |
| サンエー | 13,200 | 2,599.000 | 34,306,800 | |
| カワチ薬品 | 7,000 | 2,658.000 | 18,606,000 | |
| エービーシー・マート | 41,600 | 3,111.000 | 129,417,600 | |
| ハードオフコーポレーション | 3,500 | 1,919.000 | 6,716,500 | |
| アスクル | 22,600 | 2,009.000 | 45,403,400 | |
| ゲオホールディングス | 10,400 | 1,511.000 | 15,714,400 | |
| アダストリア | 11,200 | 3,435.000 | 38,472,000 | |
| くら寿司 | 10,900 | 3,620.000 | 39,458,000 | |
| キャンドゥ | 4,200 | 3,500.000 | 14,700,000 | |
| パルグループホールディングス | 18,800 | 2,442.000 | 45,909,600 | |
| エディオン | 35,000 | 1,848.000 | 64,680,000 | |
| サーラコーポレーション | 18,900 | 821.000 | 15,516,900 | |
| ハローズ | 4,000 | 4,170.000 | 16,680,000 | |
| フジオフードグループ本社 | 10,600 | 1,342.000 | 14,225,200 | |
| あみやき亭 | 2,400 | 5,970.000 | 14,328,000 | |
| 大黒天物産 | 3,000 | 11,660.000 | 34,980,000 | |
| ハニーズホールディングス | 8,000 | 1,615.000 | 12,920,000 | |
| アルペン | 7,300 | 2,139.000 | 15,614,700 | |
| クオールホールディングス | 12,400 | 1,381.000 | 17,124,400 | |
| ジンズホールディングス | 7,400 | 5,200.000 | 38,480,000 | |
| ビックカメラ | 55,700 | 1,554.000 | 86,557,800 | |
| ＤＣＭホールディングス | 49,200 | 1,478.000 | 72,717,600 | |
| ＭｏｎｏｔａＲＯ | 131,800 | 2,397.000 | 315,924,600 | |
| ＤＤグループ | 2,900 | 1,284.000 | 3,723,600 | |
| Ｊ．フロント　リテイリング | 106,000 | 1,475.500 | 156,403,000 | |
| ドトール・日レスホールディングス | 15,400 | 2,300.000 | 35,420,000 | |
| マツキヨココカラ＆カンパニー | 168,400 | 2,237.500 | 376,795,000 | |
| ブロンコビリー | 5,400 | 3,695.000 | 19,953,000 | |
| ＺＯＺＯ | 59,200 | 4,929.000 | 291,796,800 | |
| トレジャー・ファクトリー | 6,600 | 1,695.000 | 11,187,000 | |
| 物語コーポレーション | 15,300 | 3,645.000 | 55,768,500 | |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 153,100 | 2,196.500 | 336,284,150 | |
| Ｈａｍｅｅ | 4,900 | 1,037.000 | 5,081,300 | |
| ウエルシアホールディングス | 48,500 | 1,938.000 | 93,993,000 | |
| クリエイトＳＤホールディングス | 13,500 | 3,100.000 | 41,850,000 | |
| チムニー | 2,200 | 1,325.000 | 2,915,000 | |
| シュッピン | 8,200 | 1,178.000 | 9,659,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| オイシックス・ラ・大地 | 12,500 | 1,340.000 | 16,750,000 | |
| ネクステージ | 21,700 | 1,764.000 | 38,278,800 | |
| ジョイフル本田 | 25,700 | 2,139.000 | 54,972,300 | |
| エターナルホスピタリティグループ | 3,600 | 3,575.000 | 12,870,000 | |
| ホットランド | 7,200 | 2,331.000 | 16,783,200 | |
| すかいらーくホールディングス | 126,200 | 2,340.000 | 295,308,000 | |
| ＳＦＰホールディングス | 4,600 | 1,960.000 | 9,016,000 | |
| 綿半ホールディングス | 6,100 | 1,769.000 | 10,790,900 | |
| ヨシックスホールディングス | 2,000 | 3,240.000 | 6,480,000 | |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 32,800 | 842.000 | 27,617,600 | |
| ＢＥＥＮＯＳ | 5,600 | 2,457.000 | 13,759,200 | |
| あさひ | 7,500 | 1,618.000 | 12,135,000 | |
| 日本調剤 | 6,400 | 1,235.000 | 7,904,000 | |
| コスモス薬品 | 15,600 | 7,306.000 | 113,973,600 | |
| セブン&アイ・ホールディングス | 938,900 | 2,158.500 | 2,026,615,650 | |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 62,600 | 1,063.000 | 66,543,800 | |
| ツルハホールディングス | 19,500 | 8,607.000 | 167,836,500 | |
| サンマルクホールディングス | 7,000 | 2,127.000 | 14,889,000 | |
| フェリシモ | 4,000 | 908.000 | 3,632,000 | |
| トリドールホールディングス | 26,000 | 3,580.000 | 93,080,000 | |
| ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ | 11,600 | 228.000 | 2,644,800 | |
| ＪＭホールディングス | 6,900 | 3,290.000 | 22,701,000 | |
| アレンザホールディングス | 6,500 | 1,066.000 | 6,929,000 | |
| 串カツ田中ホールディングス | 800 | 1,448.000 | 1,158,400 | |
| クスリのアオキホールディングス | 28,200 | 3,219.000 | 90,775,800 | |
| 力の源ホールディングス | 5,500 | 1,187.000 | 6,528,500 | |
| ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ | 49,500 | 2,586.000 | 128,007,000 | |
| メディカルシステムネットワーク | 12,000 | 431.000 | 5,172,000 | |
| ノジマ | 26,900 | 1,926.000 | 51,809,400 | |
| カッパ・クリエイト | 14,400 | 1,722.000 | 24,796,800 | |
| 良品計画 | 110,400 | 2,555.000 | 282,072,000 | |
| アドヴァングループ | 4,900 | 916.000 | 4,488,400 | |
| アルビス | 2,500 | 2,811.000 | 7,027,500 | |
| Ｇ－７ホールディングス | 9,800 | 1,653.000 | 16,199,400 | |
| イオン北海道 | 31,800 | 918.000 | 29,192,400 | |
| コジマ | 17,900 | 936.000 | 16,754,400 | |
| コーナン商事 | 11,700 | 3,790.000 | 44,343,000 | |
| エコス | 3,600 | 2,094.000 | 7,538,400 | |
| ワタミ | 10,300 | 841.000 | 8,662,300 | |
| パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス | 187,400 | 3,815.000 | 714,931,000 | |
| 西松屋チェーン | 18,400 | 2,531.000 | 46,570,400 | |
| ゼンショーホールディングス | 47,300 | 7,913.000 | 374,284,900 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 幸楽苑ホールディングス | 7,000 | 1,210.000 | 8,470,000 | |
| サイゼリヤ | 13,900 | 5,130.000 | 71,307,000 | |
| ＶＴホールディングス | 33,100 | 479.000 | 15,854,900 | |
| フジ・コーポレーション | 4,200 | 2,036.000 | 8,551,200 | |
| ユナイテッドアローズ | 10,500 | 2,148.000 | 22,554,000 | |
| ハイデイ日高 | 13,400 | 2,695.000 | 36,113,000 | |
| コロワイド | 39,800 | 1,750.000 | 69,650,000 | |
| 壱番屋 | 35,500 | 1,029.000 | 36,529,500 | |
| スギホールディングス | 58,400 | 2,479.000 | 144,773,600 | |
| 薬王堂ホールディングス | 4,600 | 2,498.000 | 11,490,800 | |
| スクロール | 13,200 | 953.000 | 12,579,600 | |
| ヨンドシーホールディングス | 8,100 | 1,851.000 | 14,993,100 | |
| 木曽路 | 13,600 | 2,373.000 | 32,272,800 | |
| ＳＲＳホールディングス | 14,900 | 1,222.000 | 18,207,800 | |
| リテールパートナーズ | 13,000 | 1,368.000 | 17,784,000 | |
| 上新電機 | 8,500 | 2,736.000 | 23,256,000 | |
| 日本瓦斯 | 51,400 | 2,298.000 | 118,117,200 | |
| ロイヤルホールディングス | 16,500 | 2,388.000 | 39,402,000 | |
| いなげや | 8,600 | 1,196.000 | 10,285,600 | |
| チヨダ | 9,500 | 962.000 | 9,139,000 | |
| ライフコーポレーション | 9,400 | 3,655.000 | 34,357,000 | |
| リンガーハット | 12,100 | 2,172.000 | 26,281,200 | |
| ＭｒＭａｘＨＤ | 10,700 | 685.000 | 7,329,500 | |
| ＡＯＫＩホールディングス | 19,300 | 1,214.000 | 23,430,200 | |
| オークワ | 14,400 | 939.000 | 13,521,600 | |
| コメリ | 14,100 | 3,700.000 | 52,170,000 | |
| 青山商事 | 19,500 | 1,332.000 | 25,974,000 | |
| しまむら | 22,500 | 7,939.000 | 178,627,500 | |
| 高島屋 | 123,000 | 1,101.500 | 135,484,500 | |
| 松屋 | 15,500 | 862.000 | 13,361,000 | |
| エイチ・ツー・オー　リテイリング | 48,600 | 2,160.000 | 104,976,000 | |
| 近鉄百貨店 | 4,900 | 2,027.000 | 9,932,300 | |
| 丸井グループ | 61,000 | 2,483.000 | 151,463,000 | |
| アクシアル　リテイリング | 24,100 | 935.000 | 22,533,500 | |
| イオン | 314,500 | 4,019.000 | 1,263,975,500 | |
| イズミ | 18,900 | 3,662.000 | 69,211,800 | |
| 平和堂 | 14,900 | 2,454.000 | 36,564,600 | |
| フジ | 14,500 | 2,135.000 | 30,957,500 | |
| ヤオコー | 11,100 | 10,035.000 | 111,388,500 | |
| ゼビオホールディングス | 12,200 | 1,248.000 | 15,225,600 | |
| ケーズホールディングス | 61,500 | 1,536.000 | 94,464,000 | |
| Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ | 8,400 | 3,710.000 | 31,164,000 | |
| ブックオフグループホールディングス | 6,600 | 1,311.000 | 8,652,600 | |
| ギフトホールディングス | 4,700 | 2,599.000 | 12,215,300 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| アインホールディングス | 12,900 | 5,115.000 | 65,983,500 | |
| ＧＥＮＫＩ　ＧＬＯＢＡＬ　ＤＩＮＩＮＧ　ＣＯＮＣＥＰＴＳ | 5,800 | 4,265.000 | 24,737,000 | |
| ヤマダホールディングス | 288,200 | 443.900 | 127,931,980 | |
| アークランズ | 27,100 | 1,721.000 | 46,639,100 | |
| ニトリホールディングス | 33,800 | 22,735.000 | 768,443,000 | |
| グルメ杵屋 | 5,900 | 1,087.000 | 6,413,300 | |
| ケーユーホールディングス | 2,900 | 1,039.000 | 3,013,100 | |
| 吉野家ホールディングス | 34,100 | 3,188.000 | 108,710,800 | |
| 松屋フーズホールディングス | 4,300 | 5,970.000 | 25,671,000 | |
| サガミホールディングス | 13,800 | 1,676.000 | 23,128,800 | |
| 王将フードサービス | 6,700 | 8,380.000 | 56,146,000 | |
| ミニストップ | 6,700 | 1,646.000 | 11,028,200 | |
| アークス | 16,400 | 2,525.000 | 41,410,000 | |
| バローホールディングス | 16,900 | 2,231.000 | 37,703,900 | |
| ベルク | 4,600 | 6,310.000 | 29,026,000 | |
| 大　庄 | 5,500 | 1,068.000 | 5,874,000 | |
| ファーストリテイリング | 52,100 | 44,070.000 | 2,296,047,000 | |
| サンドラッグ | 33,000 | 4,151.000 | 136,983,000 | |
| サックスバー　ホールディングス | 7,700 | 810.000 | 6,237,000 | |
| やまや | 1,000 | 3,015.000 | 3,015,000 | |
| ベルーナ | 21,200 | 708.000 | 15,009,600 | |
| いよぎんホールディングス | 102,100 | 1,293.500 | 132,066,350 | |
| しずおかフィナンシャルグループ | 188,700 | 1,228.500 | 231,817,950 | |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ | 72,700 | 1,423.500 | 103,488,450 | |
| 楽天銀行 | 40,300 | 3,015.000 | 121,504,500 | |
| 京都フィナンシャルグループ | 108,800 | 2,115.000 | 230,112,000 | |
| じもとホールディングス | 11,000 | 280.000 | 3,080,000 | |
| めぶきフィナンシャルグループ | 405,700 | 547.600 | 222,161,320 | |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 10,600 | 4,100.000 | 43,460,000 | |
| 九州フィナンシャルグループ | 166,700 | 681.900 | 113,672,730 | |
| ゆうちょ銀行 | 948,900 | 1,300.000 | 1,233,570,000 | |
| 富山第一銀行 | 27,100 | 1,033.000 | 27,994,300 | |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 457,700 | 771.400 | 353,069,780 | |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 49,000 | 1,570.000 | 76,930,000 | |
| 三十三フィナンシャルグループ | 7,500 | 1,650.000 | 12,375,000 | |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 13,400 | 4,750.000 | 63,650,000 | |
| ひろぎんホールディングス | 119,900 | 1,065.500 | 127,753,450 | |
| おきなわフィナンシャルグループ | 6,900 | 2,252.000 | 15,538,800 | |
| 十六フィナンシャルグループ | 10,600 | 3,925.000 | 41,605,000 | |
| 北國フィナンシャルホールディングス | 8,900 | 4,380.000 | 38,982,000 | |
| プロクレアホールディングス | 10,800 | 1,763.000 | 19,040,400 | |
| あいちフィナンシャルグループ | 18,600 | 2,346.000 | 43,635,600 | |
| あおぞら銀行 | 61,500 | 2,545.500 | 156,548,250 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 5,251,700 | 1,419.000 | 7,452,162,300 | |
| りそなホールディングス | 989,100 | 971.300 | 960,712,830 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 306,600 | 3,355.000 | 1,028,643,000 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 603,900 | 8,750.000 | 5,284,125,000 | |
| 千葉銀行 | 239,500 | 1,115.000 | 267,042,500 | |
| 群馬銀行 | 166,300 | 907.100 | 150,850,730 | |
| 武蔵野銀行 | 11,000 | 2,676.000 | 29,436,000 | |
| 千葉興業銀行 | 20,300 | 929.000 | 18,858,700 | |
| 筑波銀行 | 36,200 | 237.000 | 8,579,400 | |
| 七十七銀行 | 25,100 | 3,825.000 | 96,007,500 | |
| 秋田銀行 | 5,200 | 2,204.000 | 11,460,800 | |
| 山形銀行 | 9,700 | 1,029.000 | 9,981,300 | |
| 岩手銀行 | 5,800 | 2,326.000 | 13,490,800 | |
| 東邦銀行 | 65,400 | 250.000 | 16,350,000 | |
| 東北銀行 | 4,600 | 1,130.000 | 5,198,000 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 74,500 | 3,562.000 | 265,369,000 | |
| スルガ銀行 | 72,500 | 1,122.000 | 81,345,000 | |
| 八十二銀行 | 185,200 | 804.900 | 149,067,480 | |
| 山梨中央銀行 | 9,100 | 1,584.000 | 14,414,400 | |
| 大垣共立銀行 | 15,400 | 1,820.000 | 28,028,000 | |
| 福井銀行 | 7,500 | 1,805.000 | 13,537,500 | |
| 清水銀行 | 3,600 | 1,449.000 | 5,216,400 | |
| 滋賀銀行 | 14,300 | 3,195.000 | 45,688,500 | |
| 南都銀行 | 12,400 | 3,050.000 | 37,820,000 | |
| 百五銀行 | 76,000 | 526.000 | 39,976,000 | |
| 紀陽銀行 | 30,500 | 1,709.000 | 52,124,500 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 52,000 | 1,561.500 | 81,198,000 | |
| 山陰合同銀行 | 53,100 | 1,204.000 | 63,932,400 | |
| 鳥取銀行 | 3,900 | 1,257.000 | 4,902,300 | |
| 百十四銀行 | 7,900 | 2,469.000 | 19,505,100 | |
| 四国銀行 | 13,300 | 967.000 | 12,861,100 | |
| 阿波銀行 | 12,000 | 2,447.000 | 29,364,000 | |
| 大分銀行 | 5,100 | 3,105.000 | 15,835,500 | |
| 宮崎銀行 | 5,200 | 2,685.000 | 13,962,000 | |
| 佐賀銀行 | 5,100 | 2,050.000 | 10,455,000 | |
| 琉球銀行 | 19,200 | 1,016.000 | 19,507,200 | |
| セブン銀行 | 270,400 | 285.200 | 77,118,080 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 1,163,400 | 2,746.500 | 3,195,278,100 | |
| 山口フィナンシャルグループ | 83,300 | 1,539.500 | 128,240,350 | |
| 名古屋銀行 | 5,300 | 6,240.000 | 33,072,000 | |
| 北洋銀行 | 129,900 | 377.000 | 48,972,300 | |
| 大光銀行 | 5,300 | 1,343.000 | 7,117,900 | |
| 愛媛銀行 | 11,600 | 1,056.000 | 12,249,600 | |
| トマト銀行 | 5,100 | 1,145.000 | 5,839,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 京葉銀行 | 37,400 | 700.000 | 26,180,000 | |
| 栃木銀行 | 42,100 | 259.000 | 10,903,900 | |
| 北日本銀行 | 2,600 | 2,351.000 | 6,112,600 | |
| 東和銀行 | 15,200 | 584.000 | 8,876,800 | |
| 大東銀行 | 8,500 | 666.000 | 5,661,000 | |
| トモニホールディングス | 81,100 | 376.000 | 30,493,600 | |
| フィデアホールディングス | 8,500 | 1,440.000 | 12,240,000 | |
| 池田泉州ホールディングス | 114,300 | 320.000 | 36,576,000 | |
| ＦＰＧ | 31,400 | 2,131.000 | 66,913,400 | |
| ジャパンインベストメントアドバイザー | 14,800 | 1,071.000 | 15,850,800 | |
| マーキュリアホールディングス | 2,700 | 839.000 | 2,265,300 | |
| ＳＢＩホールディングス | 137,600 | 3,211.000 | 441,833,600 | |
| ジャフコ　グループ | 26,500 | 2,016.000 | 53,424,000 | |
| 大和証券グループ本社 | 666,100 | 996.200 | 663,568,820 | |
| 野村ホールディングス | 1,447,000 | 743.400 | 1,075,699,800 | |
| 岡三証券グループ | 74,900 | 635.000 | 47,561,500 | |
| 丸三証券 | 29,100 | 966.000 | 28,110,600 | |
| 東洋証券 | 27,400 | 406.000 | 11,124,400 | |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 95,600 | 486.000 | 46,461,600 | |
| 水戸証券 | 25,200 | 416.000 | 10,483,200 | |
| いちよし証券 | 14,800 | 677.000 | 10,019,600 | |
| 松井証券 | 47,400 | 806.000 | 38,204,400 | |
| マネックスグループ | 85,200 | 610.000 | 51,972,000 | |
| 極東証券 | 13,200 | 1,437.000 | 18,968,400 | |
| 岩井コスモホールディングス | 9,400 | 1,989.000 | 18,696,600 | |
| アイザワ証券グループ | 13,600 | 1,771.000 | 24,085,600 | |
| スパークス・グループ | 9,600 | 1,289.000 | 12,374,400 | |
| かんぽ生命保険 | 88,300 | 2,553.000 | 225,429,900 | |
| ＦＰパートナー | 3,800 | 2,711.000 | 10,301,800 | |
| ＳＯＭＰＯホールディングス | 388,900 | 3,174.000 | 1,234,368,600 | |
| アニコム　ホールディングス | 29,500 | 659.000 | 19,440,500 | |
| ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス | 579,200 | 3,117.000 | 1,805,366,400 | |
| 第一生命ホールディングス | 405,300 | 3,484.000 | 1,412,065,200 | |
| 東京海上ホールディングス | 841,900 | 4,925.000 | 4,146,357,500 | |
| Ｔ＆Ｄホールディングス | 231,400 | 2,366.000 | 547,492,400 | |
| 全国保証 | 22,600 | 5,597.000 | 126,492,200 | |
| ジェイリース | 7,700 | 1,353.000 | 10,418,100 | |
| イントラスト | 3,900 | 707.000 | 2,757,300 | |
| 日本モーゲージサービス | 10,100 | 405.000 | 4,090,500 | |
| ＳＢＩアルヒ | 11,000 | 822.000 | 9,042,000 | |
| プレミアグループ | 15,300 | 2,046.000 | 31,303,800 | |
| クレディセゾン | 54,600 | 3,393.000 | 185,257,800 | |
| 芙蓉総合リース | 7,700 | 10,735.000 | 82,659,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| みずほリース | 69,400 | 1,009.000 | 70,024,600 | |
| 東京センチュリー | 64,300 | 1,646.500 | 105,869,950 | |
| 日本証券金融 | 32,000 | 1,942.000 | 62,144,000 | |
| アイフル | 130,200 | 315.000 | 41,013,000 | |
| リコーリース | 7,800 | 5,060.000 | 39,468,000 | |
| イオンフィナンシャルサービス | 48,800 | 1,238.500 | 60,438,800 | |
| アコム | 162,500 | 362.400 | 58,890,000 | |
| ジャックス | 8,900 | 3,860.000 | 34,354,000 | |
| オリエントコーポレーション | 26,800 | 937.000 | 25,111,600 | |
| オリックス | 516,900 | 3,337.000 | 1,724,895,300 | |
| 三菱ＨＣキャピタル | 379,800 | 1,019.000 | 387,016,200 | |
| 九州リースサービス | 4,800 | 991.000 | 4,756,800 | |
| 日本取引所グループ | 222,700 | 3,377.000 | 752,057,900 | |
| イー・ギャランティ | 15,100 | 1,373.000 | 20,732,300 | |
| アサックス | 2,900 | 715.000 | 2,073,500 | |
| ＮＥＣキャピタルソリューション | 3,900 | 3,785.000 | 14,761,500 | |
| Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ | 32,000 | 138.000 | 4,416,000 | |
| 大東建託 | 31,500 | 17,670.000 | 556,605,000 | |
| サムティホールディングス | 10,100 | 2,625.000 | 26,512,500 | |
| いちご | 100,700 | 354.000 | 35,647,800 | |
| 日本駐車場開発 | 102,800 | 232.000 | 23,849,600 | |
| スター・マイカ・ホールディングス | 11,000 | 594.000 | 6,534,000 | |
| ＳＲＥホールディングス | 4,000 | 4,245.000 | 16,980,000 | |
| ヒューリック | 199,700 | 1,447.000 | 288,965,900 | |
| 野村不動産ホールディングス | 47,300 | 3,889.000 | 183,949,700 | |
| 三重交通グループホールディングス | 19,100 | 490.000 | 9,359,000 | |
| ディア・ライフ | 14,200 | 878.000 | 12,467,600 | |
| 地主 | 7,000 | 1,989.000 | 13,923,000 | |
| プレサンスコーポレーション | 14,600 | 1,859.000 | 27,141,400 | |
| ＪＰＭＣ | 4,500 | 1,094.000 | 4,923,000 | |
| フージャースホールディングス | 12,200 | 1,030.000 | 12,566,000 | |
| オープンハウスグループ | 31,500 | 5,482.000 | 172,683,000 | |
| 東急不動産ホールディングス | 255,500 | 955.200 | 244,053,600 | |
| 飯田グループホールディングス | 82,000 | 2,227.500 | 182,655,000 | |
| ムゲンエステート | 4,200 | 1,507.000 | 6,329,400 | |
| Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス | 3,600 | 1,038.000 | 3,736,800 | |
| シーアールイー | 5,300 | 1,388.000 | 7,356,400 | |
| ケイアイスター不動産 | 4,200 | 3,745.000 | 15,729,000 | |
| グッドコムアセット | 8,900 | 795.000 | 7,075,500 | |
| ジェイ・エス・ビー | 4,400 | 2,675.000 | 11,770,000 | |
| ロードスターキャピタル | 5,900 | 2,287.000 | 13,493,300 | |
| 霞ヶ関キャピタル | 3,900 | 13,500.000 | 52,650,000 | |
| パーク２４ | 66,900 | 1,784.500 | 119,383,050 | |
| パラカ | 3,200 | 1,763.000 | 5,641,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 宮越ホールディングス | 4,600 | 1,791.000 | 8,238,600 | |
| 三井不動産 | 1,195,600 | 1,373.000 | 1,641,558,800 | |
| 三菱地所 | 540,800 | 2,250.000 | 1,216,800,000 | |
| 平和不動産 | 13,900 | 4,010.000 | 55,739,000 | |
| 東京建物 | 73,900 | 2,221.000 | 164,131,900 | |
| 京阪神ビルディング | 19,700 | 1,572.000 | 30,968,400 | |
| 住友不動産 | 124,400 | 4,665.000 | 580,326,000 | |
| テーオーシー | 18,100 | 633.000 | 11,457,300 | |
| レオパレス２１ | 88,100 | 590.000 | 51,979,000 | |
| スターツコーポレーション | 12,500 | 3,360.000 | 42,000,000 | |
| フジ住宅 | 10,800 | 698.000 | 7,538,400 | |
| 空港施設 | 12,000 | 579.000 | 6,948,000 | |
| 明和地所 | 6,200 | 954.000 | 5,914,800 | |
| ゴールドクレスト | 8,200 | 3,265.000 | 26,773,000 | |
| エスリード | 3,800 | 4,490.000 | 17,062,000 | |
| 日神グループホールディングス | 15,200 | 487.000 | 7,402,400 | |
| 日本エスコン | 16,700 | 1,016.000 | 16,967,200 | |
| ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス | 48,900 | 494.000 | 24,156,600 | |
| イオンモール | 44,100 | 2,081.500 | 91,794,150 | |
| 毎日コムネット | 6,300 | 705.000 | 4,441,500 | |
| カチタス | 23,600 | 1,750.000 | 41,300,000 | |
| トーセイ | 14,500 | 2,221.000 | 32,204,500 | |
| 穴吹興産 | 2,700 | 1,995.000 | 5,386,500 | |
| サンフロンティア不動産 | 13,000 | 1,751.000 | 22,763,000 | |
| ＦＪネクストホールディングス | 8,800 | 1,237.000 | 10,885,600 | |
| 日本空港ビルデング | 30,500 | 4,910.000 | 149,755,000 | |
| ＬＩＦＵＬＬ | 36,500 | 139.000 | 5,073,500 | |
| ＭＩＸＩ | 19,500 | 2,877.000 | 56,101,500 | |
| ジェイエイシーリクルートメント | 32,000 | 782.000 | 25,024,000 | |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 142,700 | 636.500 | 90,828,550 | |
| メンバーズ | 4,400 | 903.000 | 3,973,200 | |
| ＵＴグループ | 11,900 | 2,650.000 | 31,535,000 | |
| アイティメディア | 3,600 | 1,599.000 | 5,756,400 | |
| ケアネット | 18,100 | 633.000 | 11,457,300 | |
| Ｅ・Ｊホールディングス | 5,400 | 1,726.000 | 9,320,400 | |
| オープンアップグループ | 26,800 | 2,062.000 | 55,261,600 | |
| コシダカホールディングス | 27,700 | 999.000 | 27,672,300 | |
| アルトナー | 2,000 | 1,794.000 | 3,588,000 | |
| パソナグループ | 11,000 | 2,214.000 | 24,354,000 | |
| リンクアンドモチベーション | 26,700 | 620.000 | 16,554,000 | |
| エス・エム・エス | 31,900 | 2,122.000 | 67,691,800 | |
| パーソルホールディングス | 911,300 | 270.800 | 246,780,040 | |
| リニカル | 5,500 | 387.000 | 2,128,500 | |
| 学情 | 4,700 | 1,663.000 | 7,816,100 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| スタジオアリス | 4,800 | 2,077.000 | 9,969,600 | |
| ＮＪＳ | 2,000 | 3,375.000 | 6,750,000 | |
| 綜合警備保障 | 147,300 | 1,046.500 | 154,149,450 | |
| カカクコム | 57,700 | 2,579.500 | 148,837,150 | |
| セントケア・ホールディング | 7,500 | 742.000 | 5,565,000 | |
| ルネサンス | 6,700 | 1,064.000 | 7,128,800 | |
| ディップ | 13,900 | 2,762.000 | 38,391,800 | |
| デジタルホールディングス | 6,000 | 930.000 | 5,580,000 | |
| 新日本科学 | 8,700 | 1,150.000 | 10,005,000 | |
| エムスリー | 172,800 | 1,348.500 | 233,020,800 | |
| ウェルネット | 4,000 | 790.000 | 3,160,000 | |
| ワールドホールディングス | 4,200 | 1,870.000 | 7,854,000 | |
| ディー・エヌ・エー | 31,300 | 1,588.500 | 49,720,050 | |
| 博報堂ＤＹホールディングス | 115,000 | 1,174.000 | 135,010,000 | |
| ぐるなび | 16,000 | 372.000 | 5,952,000 | |
| タカミヤ | 13,200 | 431.000 | 5,689,200 | |
| ファンコミュニケーションズ | 15,000 | 406.000 | 6,090,000 | |
| ライク | 3,800 | 1,436.000 | 5,456,800 | |
| エスプール | 30,200 | 344.000 | 10,388,800 | |
| ＷＤＢホールディングス | 4,500 | 1,725.000 | 7,762,500 | |
| アドウェイズ | 14,300 | 339.000 | 4,847,700 | |
| バリューコマース | 8,700 | 1,087.000 | 9,456,900 | |
| インフォマート | 94,600 | 323.000 | 30,555,800 | |
| ＪＰホールディングス | 26,200 | 730.000 | 19,126,000 | |
| プレステージ・インターナショナル | 43,300 | 717.000 | 31,046,100 | |
| アミューズ | 5,300 | 1,399.000 | 7,414,700 | |
| ドリームインキュベータ | 3,200 | 2,177.000 | 6,966,400 | |
| クイック | 5,900 | 2,104.000 | 12,413,600 | |
| 電通グループ | 97,000 | 4,208.000 | 408,176,000 | |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 4,500 | 832.000 | 3,744,000 | |
| ぴあ | 3,100 | 3,045.000 | 9,439,500 | |
| イオンファンタジー | 3,600 | 2,132.000 | 7,675,200 | |
| シーティーエス | 10,600 | 827.000 | 8,766,200 | |
| Ｈ．Ｕ．グループホールディングス | 25,200 | 2,654.500 | 66,893,400 | |
| アルプス技研 | 8,200 | 2,717.000 | 22,279,400 | |
| 日本空調サービス | 10,200 | 1,079.000 | 11,005,800 | |
| オリエンタルランド | 476,200 | 3,902.000 | 1,858,132,400 | |
| ダスキン | 18,600 | 3,865.000 | 71,889,000 | |
| 明光ネットワークジャパン | 13,800 | 677.000 | 9,342,600 | |
| ファルコホールディングス | 4,900 | 2,313.000 | 11,333,700 | |
| ラウンドワン | 83,400 | 1,001.000 | 83,483,400 | |
| リゾートトラスト | 39,000 | 2,900.000 | 113,100,000 | |
| ビー・エム・エル | 11,500 | 2,663.000 | 30,624,500 | |
| リソー教育 | 50,900 | 250.000 | 12,725,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 早稲田アカデミー | 5,500 | 1,582.000 | 8,701,000 | |
| ユー・エス・エス | 200,300 | 1,360.500 | 272,508,150 | |
| 東京個別指導学院 | 19,000 | 403.000 | 7,657,000 | |
| サイバーエージェント | 198,400 | 1,024.000 | 203,161,600 | |
| 楽天グループ | 635,300 | 942.900 | 599,024,370 | |
| クリーク・アンド・リバー社 | 5,100 | 1,427.000 | 7,277,700 | |
| ＳＢＩグローバルアセットマネジメント | 18,000 | 587.000 | 10,566,000 | |
| テー・オー・ダブリュー | 23,800 | 313.000 | 7,449,400 | |
| 山田コンサルティンググループ | 4,300 | 2,363.000 | 10,160,900 | |
| セントラルスポーツ | 3,700 | 2,495.000 | 9,231,500 | |
| フルキャストホールディングス | 8,800 | 1,558.000 | 13,710,400 | |
| エン・ジャパン | 15,200 | 2,502.000 | 38,030,400 | |
| テクノプロ・ホールディングス | 52,000 | 2,890.000 | 150,280,000 | |
| アイ・アールジャパンホールディングス | 5,400 | 902.000 | 4,870,800 | |
| ＫｅｅＰｅｒ技研 | 5,700 | 4,265.000 | 24,310,500 | |
| Ｇｕｎｏｓｙ | 9,200 | 868.000 | 7,985,600 | |
| イー・ガーディアン | 4,300 | 1,838.000 | 7,903,400 | |
| ジャパンマテリアル | 27,200 | 1,746.000 | 47,491,200 | |
| ベクトル | 11,700 | 905.000 | 10,588,500 | |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 7,900 | 1,369.000 | 10,815,100 | |
| キャリアリンク | 3,600 | 2,589.000 | 9,320,400 | |
| ＩＢＪ | 8,600 | 703.000 | 6,045,800 | |
| アサンテ | 5,200 | 1,670.000 | 8,684,000 | |
| バリューＨＲ | 8,000 | 1,614.000 | 12,912,000 | |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 7,700 | 2,160.000 | 16,632,000 | |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 6,200 | 1,005.000 | 6,231,000 | |
| ＥＲＩホールディングス | 1,000 | 1,961.000 | 1,961,000 | |
| シグマクシス・ホールディングス | 12,300 | 1,599.000 | 19,667,700 | |
| ウィルグループ | 7,000 | 898.000 | 6,286,000 | |
| メドピア | 9,400 | 585.000 | 5,499,000 | |
| リクルートホールディングス | 648,400 | 8,650.000 | 5,608,660,000 | |
| エラン | 12,000 | 828.000 | 9,936,000 | |
| 日本郵政 | 939,100 | 1,352.500 | 1,270,132,750 | |
| ベルシステム２４ホールディングス | 11,300 | 1,527.000 | 17,255,100 | |
| 鎌倉新書 | 9,900 | 493.000 | 4,880,700 | |
| エアトリ | 7,200 | 1,177.000 | 8,474,400 | |
| アトラエ | 7,800 | 792.000 | 6,177,600 | |
| ストライク | 4,200 | 4,550.000 | 19,110,000 | |
| ソラスト | 25,400 | 560.000 | 14,224,000 | |
| セラク | 2,500 | 1,410.000 | 3,525,000 | |
| インソース | 20,100 | 1,055.000 | 21,205,500 | |
| ベイカレント | 66,300 | 5,129.000 | 340,052,700 | |
| Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ | 2,500 | 819.000 | 2,047,500 | |
| アイモバイル | 14,100 | 503.000 | 7,092,300 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ＭＳ－Ｊａｐａｎ | 4,000 | 999.000 | 3,996,000 | |
| ジャパンエレベーターサービスホールディングス | 29,000 | 2,761.000 | 80,069,000 | |
| グリーンズ | 1,200 | 1,677.000 | 2,012,400 | |
| エル・ティー・エス | 1,300 | 1,782.000 | 2,316,600 | |
| ミダックホールディングス | 5,700 | 1,615.000 | 9,205,500 | |
| キュービーネットホールディングス | 5,900 | 1,047.000 | 6,177,300 | |
| オープングループ | 16,600 | 210.000 | 3,486,000 | |
| マネジメントソリューションズ | 4,300 | 1,530.000 | 6,579,000 | |
| フロンティア・マネジメント | 2,600 | 1,146.000 | 2,979,600 | |
| コプロ・ホールディングス | 1,600 | 1,519.000 | 2,430,400 | |
| アンビスホールディングス | 19,400 | 1,777.000 | 34,473,800 | |
| カーブスホールディングス | 24,400 | 756.000 | 18,446,400 | |
| フォーラムエンジニアリング | 13,000 | 962.000 | 12,506,000 | |
| ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ | 3,800 | 1,218.000 | 4,628,400 | |
| ダイレクトマーケティングミックス | 13,800 | 243.000 | 3,353,400 | |
| ポピンズ | 1,600 | 1,466.000 | 2,345,600 | |
| ＬＩＴＡＬＩＣＯ | 7,200 | 1,191.000 | 8,575,200 | |
| リログループ | 44,700 | 1,817.000 | 81,219,900 | |
| 東祥 | 6,000 | 680.000 | 4,080,000 | |
| ＩＤ＆Ｅ　ホールディングス | 5,600 | 3,990.000 | 22,344,000 | |
| ビーウィズ | 2,400 | 1,853.000 | 4,447,200 | |
| サンウェルズ | 5,100 | 1,987.000 | 10,133,700 | |
| ＴＲＥホールディングス | 17,900 | 1,555.000 | 27,834,500 | |
| 人・夢・技術グループ | 3,600 | 1,704.000 | 6,134,400 | |
| ＮＩＳＳＯホールディングス | 9,000 | 768.000 | 6,912,000 | |
| 大栄環境 | 16,400 | 3,015.000 | 49,446,000 | |
| 日本管財ホールディングス | 8,900 | 2,605.000 | 23,184,500 | |
| Ｍ＆Ａ総研ホールディングス | 9,700 | 2,904.000 | 28,168,800 | |
| エイチ・アイ・エス | 28,100 | 1,659.000 | 46,617,900 | |
| 共立メンテナンス | 28,600 | 2,259.500 | 64,621,700 | |
| イチネンホールディングス | 9,100 | 1,810.000 | 16,471,000 | |
| 建設技術研究所 | 4,600 | 4,380.000 | 20,148,000 | |
| スペース | 7,100 | 1,118.000 | 7,937,800 | |
| 燦ホールディングス | 8,500 | 1,180.000 | 10,030,000 | |
| スバル興業 | 3,200 | 2,973.000 | 9,513,600 | |
| 東京テアトル | 7,000 | 1,106.000 | 7,742,000 | |
| ナガワ | 2,900 | 7,180.000 | 20,822,000 | |
| 東京都競馬 | 7,600 | 4,120.000 | 31,312,000 | |
| カナモト | 14,400 | 2,941.000 | 42,350,400 | |
| ニシオホールディングス | 8,300 | 4,060.000 | 33,698,000 | |
| トランス・コスモス | 11,300 | 3,520.000 | 39,776,000 | |
| 乃村工藝社 | 40,100 | 815.000 | 32,681,500 | |
| 藤田観光 | 4,000 | 9,230.000 | 36,920,000 | |
| ＫＮＴ－ＣＴホールディングス | 6,100 | 1,277.000 | 7,789,700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| トーカイ | 7,600 | 2,141.000 | 16,271,600 | |
| セコム | 91,000 | 11,040.000 | 1,004,640,000 | |
| セントラル警備保障 | 5,000 | 2,750.000 | 13,750,000 | |
| 丹青社 | 18,200 | 842.000 | 15,324,400 | |
| メイテックグループホールディングス | 29,600 | 3,244.000 | 96,022,400 | |
| 応用地質 | 8,700 | 2,510.000 | 21,837,000 | |
| 船井総研ホールディングス | 18,500 | 2,275.000 | 42,087,500 | |
| いであ | 700 | 2,257.000 | 1,579,900 | |
| 学究社 | 4,200 | 1,948.000 | 8,181,600 | |
| イオンディライト | 9,700 | 4,115.000 | 39,915,500 | |
| ダイセキ | 18,100 | 3,785.000 | 68,508,500 | |
| ステップ | 3,200 | 1,943.000 | 6,217,600 | |
| 合　計 | 142,796,700 | | 315,066,198,890 | |

(b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

| | (2024年9月17日現在) |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 7,456,924,895 |
| 金銭信託 | 6,459,618 |
| コール・ローン | 642,239,656 |
| 株式 | 758,251,843,710 |
| 投資証券 | 16,563,925,164 |
| 派生商品評価勘定 | 124,880,923 |
| 未収入金 | 13,722,643 |
| 未収配当金 | 1,138,797,826 |
| 差入委託証拠金 | 3,235,576,151 |
| 流動資産合計 | 787,434,370,586 |
| 資産合計 | 787,434,370,586 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 24,356,897 |
| 未払解約金 | 204,421,002 |
| 流動負債合計 | 228,777,899 |
| 負債合計 | 228,777,899 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |

| | |
|---|---|
| 元本 | 89,293,103,807 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 697,912,488,880 |
| 元本等合計 | 787,205,592,687 |
| 純資産合計 | 787,205,592,687 |
| 負債純資産合計 | 787,434,370,586 |

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式、新株予約権証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | (1) 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。<br>(2) 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| ３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。 |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | (2024年9月17日現在) |
|---|---|
| １．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 89,293,103,807口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　8.8160円 |

| | |
|---|---|
| | （1万口当たりの純資産額88,160円） |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

| 項　目 | 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| 1．　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容<br>1) 有価証券<br>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資証券を組み入れております。<br>2) デリバティブ取引<br>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。<br>当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。<br>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>(2) 金融商品に係るリスク<br>有価証券およびデリバティブ取引等<br>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |
| 3．　金融商品に係るリスク管理体制 | リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。<br>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。<br>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れ |

| | |
|---|---|
| | は、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。 |

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | (2024年9月17日現在) |
|---|---|
| 1．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（株式、新株予約権証券、投資証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区　分 | 種　類 | 契　約　額　等 | うち1年超 | 時　価 | 評価損益 |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | S&P 500 EMINI FUT SEP24 | 9,697,328,568 | － | 9,801,716,561 | 104,387,993 |
| | SPI 200 FUTURES SEP24 | 340,301,635 | － | 346,514,558 | 6,212,923 |
| | FTSE 100 IDX FUT SEP24 | 494,062,144 | － | 492,431,398 | △1,630,746 |
| | EURO STOXX 50 SEP24 | 1,683,087,836 | － | 1,677,580,407 | △5,507,429 |
| | 小計 | 12,214,780,183 | － | 12,318,242,924 | 103,462,741 |
| 合　計 | | 12,214,780,183 | － | 12,318,242,924 | 103,462,741 |

(注) 1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に

準ずる方法で評価しております。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（単位：円）

| 区　分 | 種　類 | 契　約　額　等 | | 時　価 | 評価損益 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | うち１年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 453,699,747 | － | 450,483,130 | △3,216,617 |
| | スウェーデン・クローナ | 39,563,120 | － | 39,839,312 | 276,192 |
| | 小計 | 493,262,867 | － | 490,322,442 | △2,940,425 |
| | 売建 | | | | |
| | オーストラリア・ドル | 28,461,900 | － | 28,460,190 | 1,710 |
| | 小計 | 28,461,900 | － | 28,460,190 | 1,710 |
| 合　計 | | 521,724,767 | － | 518,782,632 | △2,938,715 |

（注）１．時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2)計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

| 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

（その他の注記）

| （2024年9月17日現在） |
|---|

| | |
|---|---|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 80,676,406,829円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 16,986,404,251円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 8,369,707,273円 |
| | |
| 2024年9月17日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・ＤＣ外国株式インデックスファンドＳ | 44,981,134,476円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型） | 247,742,375円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型） | 956,054,621円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型） | 766,986,589円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 39,440,707円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ） | 679,815円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ） | 2,679,721円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ） | 11,113,114円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ） | 33,803,961円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ） | 42,254,871円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ） | 95,689,898円 |
| 外国株式指数ファンド | 1,206,304,151円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド | 24,324,748,344円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 23,754,138円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 67,345,056円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 40,858,189円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０ | 33,382,010円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 157,575,065円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 145,828,305円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 585,211,507円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 363,159,021円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 522,081,349円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 70,941,793円 |
| 三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド | 3,126,855,164円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型） | 11,128,354円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型） | 57,165,915円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型） | 61,059,103円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０ | 4,714,636円 |
| ＳＭＢＣ・ＤＣインデックスファンド（ＭＳＣＩコクサイ） | 2,309,600,108円 |
| 日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジあり） | 164,819,022円 |
| 日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジなし） | 3,644,281,479円 |
| 三井住友ＤＳ・先進国株式インデックス・ファンド | 167,821,130円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５ | 9,630,196円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０ | 6,305,022円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５ | 7,095,394円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５ | 3,948,075円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５ | 2,562,663円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 175,874円 |

| | |
|---|---|
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 5,135,554円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 25,249,598円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 27,273,315円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 10,630,651円 |
| ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 235,799,660円 |
| バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞ | 1,694,845円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞ | 8,507,417円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 244,702,267円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞ | 451,986,789円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 2,044,178,308円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞ | 6,385,797円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞ | 32,476,182円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞ | 336,590,787円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞ | 23,753,768円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 54,210,390円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 286,136,389円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞ | 183,205,513円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞ | 404,330,166円 |
| 三井住友・外国株式インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用） | 165,260,941円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 35,586,512円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 4,094,878円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 3,762,642円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 3,045,479円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 9,255,993円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 31,912,804円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 68,971,315円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 28,947,304円 |
| ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 113,387,274円 |
| ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞ | 42,612,522円 |
| ＳＭＡＭ・外国株式インデックスファンドＳＡ＜適格機関投資家限定＞ | 20,452,057円 |
| ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 17,673,700円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞ | 11,287,097円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞ | 18,145,014円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞ | 12,599,975円 |
| ＳＭＤＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定＞ | 27,929,693円 |
| 合　計 | 89,293,103,807円 |

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

| 通　貨 | 銘　柄 | 株　数 | 評価額 | | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカ・ドル | APA CORP | 27,608 | 24.440 | 674,739.52 | |
| | BAKER HUGHES CO | 87,866 | 33.980 | 2,985,686.68 | |
| | CHENIERE ENERGY INC | 19,829 | 182.550 | 3,619,783.95 | |
| | CHESAPEAKE ENERGY CORP | 7,695 | 73.060 | 562,196.70 | |
| | CHEVRON CORP | 150,477 | 142.090 | 21,381,276.93 | |
| | CHORD ENERGY CORP | 5,159 | 134.410 | 693,421.19 | |
| | CONOCOPHILLIPS | 97,908 | 105.550 | 10,334,189.40 | |
| | COTERRA ENERGY INC | 59,741 | 22.920 | 1,369,263.72 | |
| | DEVON ENERGY CORP | 49,897 | 39.640 | 1,977,917.08 | |
| | DIAMONDBACK ENERGY INC | 14,567 | 174.810 | 2,546,457.27 | |
| | EOG RESOURCES INC | 50,302 | 121.670 | 6,120,244.34 | |
| | EQT CORP | 47,708 | 33.550 | 1,600,603.40 | |
| | EXXON MOBIL CORP | 384,075 | 112.710 | 43,289,093.25 | |
| | HALLIBURTON CO | 76,654 | 28.410 | 2,177,740.14 | |
| | HESS CORP | 23,450 | 128.920 | 3,023,174.00 | |
| | HF SINCLAIR CORP | 10,663 | 45.300 | 483,033.90 | |
| | KINDER MORGAN INC | 173,893 | 21.470 | 3,733,482.71 | |
| | MARATHON OIL CORP | 53,220 | 26.660 | 1,418,845.20 | |
| | MARATHON PETROLEUM CORP | 30,431 | 161.010 | 4,899,695.31 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 57,692 | 51.290 | 2,959,022.68 | |
| | ONEOK INC | 47,832 | 93.680 | 4,480,901.76 | |
| | OVINTIV INC | 23,075 | 39.160 | 903,617.00 | |
| | PHILLIPS 66 | 36,059 | 127.340 | 4,591,753.06 | |
| | SCHLUMBERGER LTD | 121,500 | 40.400 | 4,908,600.00 | |
| | TARGA RESOURCES CORP | 18,523 | 150.590 | 2,789,378.57 | |
| | TEXAS PACIFIC LAND CORP | 1,661 | 838.610 | 1,392,931.21 | |
| | VALERO ENERGY CORP | 27,819 | 133.750 | 3,720,791.25 | |
| | WILLIAMS COS INC | 104,963 | 45.440 | 4,769,518.72 | |
| | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 18,963 | 288.870 | 5,477,841.81 | |
| | ALBEMARLE CORP | 8,338 | 89.350 | 745,000.30 | |
| | AMCOR PLC | 122,899 | 11.120 | 1,366,636.88 | |
| | AVERY DENNISON CORP | 6,759 | 221.040 | 1,494,009.36 | |
| | BALL CORP | 28,423 | 67.000 | 1,904,341.00 | |
| | CELANESE CORP | 8,742 | 123.800 | 1,082,259.60 | |
| | CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 14,020 | 79.730 | 1,117,814.60 | |
| | CORTEVA INC | 60,038 | 56.270 | 3,378,338.26 | |
| | CRH PLC | 58,997 | 89.170 | 5,260,762.49 | |
| | CROWN HOLDINGS INC | 9,413 | 92.470 | 870,420.11 | |
| | DOW INC | 59,685 | 50.660 | 3,023,642.10 | |
| | DUPONT DE NEMOURS INC | 36,397 | 82.000 | 2,984,554.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| EASTMAN CHEMICAL CO | 9,517 | 105.380 | 1,002,901.46 | |
| ECOLAB INC | 21,611 | 253.200 | 5,471,905.20 | |
| FREEPORT-MCMORAN INC | 121,991 | 42.890 | 5,232,193.99 | |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 29,910 | 49.830 | 1,490,415.30 | |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 20,983 | 103.640 | 2,174,678.12 | |
| LINDE PLC | 40,847 | 474.910 | 19,398,648.77 | |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 22,165 | 94.080 | 2,085,283.20 | |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 5,394 | 529.780 | 2,857,633.32 | |
| MOSAIC CO/THE | 25,489 | 25.430 | 648,185.27 | |
| NEWMONT CORP | 101,538 | 53.130 | 5,394,713.94 | |
| NUCOR CORP | 20,787 | 142.960 | 2,971,709.52 | |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 7,111 | 214.590 | 1,525,949.49 | |
| PPG INDUSTRIES INC | 21,291 | 127.340 | 2,711,195.94 | |
| RELIANCE INC | 5,040 | 279.290 | 1,407,621.60 | |
| RPM INTERNATIONAL INC | 10,397 | 122.160 | 1,270,097.52 | |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 20,286 | 379.060 | 7,689,611.16 | |
| SMURFIT WESTROCK PLC | 47,029 | 46.730 | 2,197,665.17 | |
| STEEL DYNAMICS INC | 12,713 | 111.010 | 1,411,270.13 | |
| VULCAN MATERIALS CO | 11,015 | 242.870 | 2,675,213.05 | |
| WESTLAKE CORP | 4,430 | 141.200 | 625,516.00 | |
| 3M CO | 46,568 | 134.610 | 6,268,518.48 | |
| AECOM | 10,261 | 98.410 | 1,009,785.01 | |
| AERCAP HOLDINGS NV | 18,294 | 93.940 | 1,718,538.36 | |
| ALLEGION PLC | 6,843 | 142.720 | 976,632.96 | |
| AMETEK INC | 20,578 | 168.350 | 3,464,306.30 | |
| AXON ENTERPRISE INC | 5,927 | 385.770 | 2,286,458.79 | |
| BOEING CO/THE | 50,840 | 155.550 | 7,908,162.00 | |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 9,801 | 187.650 | 1,839,157.65 | |
| CARLISLE COS INC | 4,354 | 418.290 | 1,821,234.66 | |
| CARRIER GLOBAL CORP | 66,639 | 77.110 | 5,138,533.29 | |
| CATERPILLAR INC | 41,903 | 347.960 | 14,580,567.88 | |
| CNH INDUSTRIAL NV | 87,561 | 10.280 | 900,127.08 | |
| CUMMINS INC | 11,429 | 301.070 | 3,440,929.03 | |
| DEERE & CO | 22,561 | 394.660 | 8,903,924.26 | |
| DOVER CORP | 12,242 | 186.770 | 2,286,438.34 | |
| EATON CORP PLC | 33,582 | 306.550 | 10,294,562.10 | |
| EMCOR GROUP INC | 4,293 | 402.690 | 1,728,748.17 | |
| EMERSON ELECTRIC CO | 48,843 | 102.390 | 5,001,034.77 | |
| FASTENAL CO | 47,002 | 70.090 | 3,294,370.18 | |
| FERGUSON ENTERPRISES INC | 18,035 | 197.220 | 3,556,862.70 | |
| FORTIVE CORP | 29,388 | 73.720 | 2,166,483.36 | |
| FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I | 10,648 | 84.100 | 895,496.80 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GE VERNOVA INC | 24,156 | 229.930 | 5,554,189.08 | |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 19,558 | 307.550 | 6,015,062.90 | |
| GENERAL ELECTRIC | 93,374 | 181.440 | 16,941,778.56 | |
| GRACO INC | 15,068 | 83.970 | 1,265,259.96 | |
| HEICO CORP | 3,085 | 262.220 | 808,948.70 | |
| HEICO CORP-CLASS A | 6,593 | 204.020 | 1,345,103.86 | |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 56,350 | 204.680 | 11,533,718.00 | |
| HOWMET AEROSPACE INC | 33,070 | 95.140 | 3,146,279.80 | |
| HUBBELL INC | 4,737 | 408.820 | 1,936,580.34 | |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 2,888 | 265.210 | 765,926.48 | |
| IDEX CORP | 6,048 | 202.680 | 1,225,808.64 | |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 26,116 | 255.130 | 6,662,975.08 | |
| INGERSOLL-RAND INC | 33,421 | 90.940 | 3,039,305.74 | |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 11,600 | 36.920 | 428,272.00 | |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 57,700 | 72.510 | 4,183,827.00 | |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 15,814 | 231.710 | 3,664,261.94 | |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 2,750 | 603.500 | 1,659,625.00 | |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 18,178 | 572.920 | 10,414,539.76 | |
| MASCO CORP | 19,187 | 81.040 | 1,554,914.48 | |
| NORDSON CORP | 5,282 | 253.370 | 1,338,300.34 | |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 12,313 | 521.270 | 6,418,397.51 | |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 35,270 | 94.810 | 3,343,948.70 | |
| OWENS CORNING | 7,597 | 167.770 | 1,274,548.69 | |
| PACCAR INC | 43,068 | 95.700 | 4,121,607.60 | |
| PARKER HANNIFIN CORP | 10,784 | 596.780 | 6,435,675.52 | |
| PENTAIR PLC | 15,664 | 92.950 | 1,455,968.80 | |
| QUANTA SERVICES INC | 13,102 | 271.540 | 3,557,717.08 | |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 9,863 | 262.080 | 2,584,895.04 | |
| RTX CORP | 114,772 | 119.200 | 13,680,822.40 | |
| SMITH (A.O.) CORP | 10,652 | 81.700 | 870,268.40 | |
| SNAP-ON INC | 4,041 | 281.440 | 1,137,299.04 | |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 12,917 | 102.590 | 1,325,155.03 | |
| TEXTRON INC | 14,870 | 88.330 | 1,313,467.10 | |
| TORO CO | 8,097 | 84.710 | 685,896.87 | |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 19,070 | 368.890 | 7,034,732.30 | |
| TRANSDIGM GROUP INC | 4,733 | 1,372.920 | 6,498,030.36 | |
| UNITED RENTALS INC | 5,643 | 741.960 | 4,186,880.28 | |
| VERTIV HOLDINGS CO-A | 32,504 | 86.990 | 2,827,522.96 | |
| WABTEC CORP | 15,150 | 170.190 | 2,578,378.50 | |
| WATSCO INC | 3,112 | 487.330 | 1,516,570.96 | |
| WW GRAINGER INC | 3,717 | 1,008.210 | 3,747,516.57 | |
| XYLEM INC | 19,463 | 132.790 | 2,584,491.77 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 34,745 | 278.600 | 9,679,957.00 | |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 10,637 | 158.450 | 1,685,432.65 | |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 10,783 | 211.640 | 2,282,114.12 | |
| CINTAS CORP | 31,608 | 204.950 | 6,478,059.60 | |
| COPART INC | 72,947 | 49.750 | 3,629,113.25 | |
| DAYFORCE INC | 10,485 | 59.600 | 624,906.00 | |
| EQUIFAX INC | 10,373 | 304.110 | 3,154,533.03 | |
| JACOBS SOLUTIONS INC | 10,393 | 144.790 | 1,504,802.47 | |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 11,403 | 154.810 | 1,765,298.43 | |
| PAYCHEX INC | 27,578 | 135.190 | 3,728,269.82 | |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 3,778 | 169.090 | 638,822.02 | |
| REPUBLIC SERVICES INC | 19,598 | 205.360 | 4,024,645.28 | |
| ROLLINS INC | 25,137 | 50.910 | 1,279,724.67 | |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 19,314 | 75.510 | 1,458,400.14 | |
| TRANSUNION | 18,291 | 101.180 | 1,850,683.38 | |
| VERALTO CORP | 22,013 | 109.960 | 2,420,549.48 | |
| VERISK ANALYTICS INC | 12,690 | 269.400 | 3,418,686.00 | |
| WASTE CONNECTIONS INC | 22,344 | 185.510 | 4,145,035.44 | |
| WASTE MANAGEMENT INC | 33,524 | 208.320 | 6,983,719.68 | |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 8,726 | 100.310 | 875,305.06 | |
| CSX CORP | 165,227 | 33.810 | 5,586,324.87 | |
| DELTA AIR LINES INC | 14,192 | 45.320 | 643,181.44 | |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 13,237 | 121.080 | 1,602,735.96 | |
| FEDEX CORP | 19,408 | 292.630 | 5,679,363.04 | |
| GRAB HOLDINGS LTD - CL A | 216,253 | 3.500 | 756,885.50 | |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 6,308 | 167.400 | 1,055,959.20 | |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 12,089 | 52.310 | 632,375.59 | |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 19,928 | 247.070 | 4,923,610.96 | |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 16,449 | 191.920 | 3,156,892.08 | |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 14,057 | 28.540 | 401,186.78 | |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 157,907 | 71.520 | 11,293,508.64 | |
| U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING | 5,850 | 69.420 | 406,107.00 | |
| UNION PACIFIC CORP | 52,696 | 252.430 | 13,302,051.28 | |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 61,570 | 128.910 | 7,936,988.70 | |
| APTIV PLC | 23,575 | 68.790 | 1,621,724.25 | |
| FORD MOTOR CO | 325,996 | 10.800 | 3,520,756.80 | |
| GENERAL MOTORS CO | 99,425 | 46.870 | 4,660,049.75 | |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A | 72,072 | 13.200 | 951,350.40 | |
| TESLA INC | 245,643 | 226.780 | 55,706,919.54 | |
| DECKERS OUTDOOR CORP | 2,220 | 937.680 | 2,081,649.60 | |
| DR HORTON INC | 26,159 | 194.600 | 5,090,541.40 | |
| GARMIN LTD | 13,282 | 172.620 | 2,292,738.84 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| LENNAR CORP-A | 21,335 | 187.210 | 3,994,125.35 | |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 10,287 | 265.300 | 2,729,141.10 | |
| NIKE INC -CL B | 102,257 | 79.800 | 8,160,108.60 | |
| NVR INC | 250 | 9,425.370 | 2,356,342.50 | |
| PULTEGROUP INC | 17,535 | 140.060 | 2,455,952.10 | |
| AIRBNB INC-CLASS A | 38,522 | 117.550 | 4,528,261.10 | |
| BOOKING HOLDINGS INC | 2,870 | 3,979.000 | 11,419,730.00 | |
| CARNIVAL CORP | 84,815 | 17.830 | 1,512,251.45 | |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 117,100 | 57.660 | 6,751,986.00 | |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 9,323 | 160.140 | 1,492,985.22 | |
| DOMINO'S PIZZA INC | 2,875 | 408.970 | 1,175,788.75 | |
| DOORDASH INC - A | 24,823 | 130.870 | 3,248,586.01 | |
| DRAFTKINGS INC-CL A | 32,265 | 38.240 | 1,233,813.60 | |
| EXPEDIA GROUP INC | 10,081 | 135.790 | 1,368,898.99 | |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI | 15,951 | 224.340 | 3,578,447.34 | |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 21,638 | 218.100 | 4,719,247.80 | |
| HYATT HOTELS CORP - CL A | 3,371 | 144.850 | 488,289.35 | |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 27,977 | 40.260 | 1,126,354.02 | |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 20,953 | 232.460 | 4,870,734.38 | |
| MCDONALD'S CORP | 61,103 | 296.690 | 18,128,649.07 | |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 22,198 | 36.440 | 808,895.12 | |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 21,669 | 169.740 | 3,678,096.06 | |
| STARBUCKS CORP | 95,086 | 96.310 | 9,157,732.66 | |
| WYNN RESORTS LTD | 7,730 | 78.950 | 610,283.50 | |
| YUM! BRANDS INC | 25,236 | 134.560 | 3,395,756.16 | |
| AMAZON.COM INC | 799,908 | 184.890 | 147,894,990.12 | |
| AUTOZONE INC | 1,423 | 3,101.040 | 4,412,779.92 | |
| BATH & BODY WORKS INC | 15,400 | 28.910 | 445,214.00 | |
| BEST BUY CO INC | 19,353 | 98.790 | 1,911,882.87 | |
| BURLINGTON STORES INC | 6,047 | 272.080 | 1,645,267.76 | |
| CARMAX INC | 14,212 | 79.040 | 1,123,316.48 | |
| DICK'S SPORTING GOODS INC | 4,406 | 212.330 | 935,525.98 | |
| EBAY INC | 40,534 | 64.360 | 2,608,768.24 | |
| GENUINE PARTS CO | 12,304 | 137.350 | 1,689,954.40 | |
| GLOBAL-E ONLINE LTD | 7,348 | 36.790 | 270,332.92 | |
| HOME DEPOT INC | 85,029 | 382.010 | 32,481,928.29 | |
| LKQ CORP | 24,732 | 40.430 | 999,914.76 | |
| LOWE'S COS INC | 48,054 | 256.640 | 12,332,578.56 | |
| MERCADOLIBRE INC | 3,878 | 2,105.510 | 8,165,167.78 | |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 4,881 | 1,130.720 | 5,519,044.32 | |
| POOL CORP | 3,252 | 358.490 | 1,165,809.48 | |
| ROSS STORES INC | 29,519 | 153.170 | 4,521,425.23 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| TJX COMPANIES INC | 95,580 | 119.610 | 11,432,323.80 | |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 9,377 | 283.390 | 2,657,348.03 | |
| ULTA BEAUTY INC | 3,734 | 389.290 | 1,453,608.86 | |
| WILLIAMS-SONOMA INC | 10,952 | 145.020 | 1,588,259.04 | |
| ALBERTSONS COS INC - CLASS A | 31,907 | 18.860 | 601,766.02 | |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 38,003 | 907.870 | 34,501,783.61 | |
| DOLLAR GENERAL CORP | 18,277 | 85.750 | 1,567,252.75 | |
| DOLLAR TREE INC | 15,923 | 71.910 | 1,145,022.93 | |
| KROGER CO | 56,767 | 56.190 | 3,189,737.73 | |
| SYSCO CORP | 44,624 | 77.120 | 3,441,402.88 | |
| TARGET CORP | 38,491 | 152.840 | 5,882,964.44 | |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 52,808 | 9.020 | 476,328.16 | |
| WALMART INC | 379,538 | 80.560 | 30,575,581.28 | |
| ALTRIA GROUP INC | 143,314 | 51.700 | 7,409,333.80 | |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 42,289 | 60.410 | 2,554,678.49 | |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 18,548 | 46.620 | 864,707.76 | |
| BUNGE GLOBAL SA | 12,343 | 97.290 | 1,200,850.47 | |
| CAMPBELL SOUP CO | 12,945 | 51.560 | 667,444.20 | |
| CELSIUS HOLDINGS INC | 11,375 | 33.180 | 377,422.50 | |
| COCA-COLA CO/THE | 351,399 | 72.100 | 25,335,867.90 | |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 18,105 | 81.880 | 1,482,437.40 | |
| CONAGRA BRANDS INC | 39,722 | 32.600 | 1,294,937.20 | |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 13,962 | 253.650 | 3,541,461.30 | |
| GENERAL MILLS INC | 46,029 | 74.630 | 3,435,144.27 | |
| HERSHEY CO/THE | 12,733 | 200.810 | 2,556,913.73 | |
| HORMEL FOODS CORP | 25,536 | 32.530 | 830,686.08 | |
| JM SMUCKER CO/THE | 8,172 | 120.880 | 987,831.36 | |
| KELLANOVA | 25,249 | 80.680 | 2,037,089.32 | |
| KEURIG DR PEPPER INC | 93,410 | 37.350 | 3,488,863.50 | |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 82,333 | 35.630 | 2,933,524.79 | |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 10,534 | 64.760 | 682,181.84 | |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 22,009 | 84.760 | 1,865,482.84 | |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B | 16,433 | 55.500 | 912,031.50 | |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 113,082 | 75.530 | 8,541,083.46 | |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 63,778 | 50.750 | 3,236,733.50 | |
| PEPSICO INC | 118,115 | 177.210 | 20,931,159.15 | |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 133,950 | 125.970 | 16,873,681.50 | |
| TYSON FOODS INC-CL A | 25,497 | 61.850 | 1,576,989.45 | |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 19,954 | 105.220 | 2,099,559.88 | |
| CLOROX COMPANY | 10,423 | 165.950 | 1,729,696.85 | |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 65,674 | 105.430 | 6,924,009.82 | |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 19,241 | 85.130 | 1,637,986.33 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| KENVUE INC | 158,991 | 23.380 | 3,717,209.58 | |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 28,172 | 144.200 | 4,062,402.40 | |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 202,313 | 177.240 | 35,857,956.12 | |
| ABBOTT LABORATORIES | 149,852 | 117.630 | 17,627,090.76 | |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 5,703 | 249.560 | 1,423,240.68 | |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 39,241 | 40.260 | 1,579,842.66 | |
| BECTON DICKINSON AND CO | 24,215 | 234.040 | 5,667,278.60 | |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 124,087 | 83.510 | 10,362,505.37 | |
| CARDINAL HEALTH INC | 20,986 | 113.280 | 2,377,294.08 | |
| CENCORA INC | 15,601 | 241.240 | 3,763,585.24 | |
| CENTENE CORP | 44,436 | 76.570 | 3,402,464.52 | |
| COOPER COS INC/THE | 17,340 | 111.230 | 1,928,728.20 | |
| CVS HEALTH CORP | 104,686 | 58.370 | 6,110,521.82 | |
| DAVITA INC | 4,138 | 165.190 | 683,556.22 | |
| DEXCOM INC | 33,202 | 70.090 | 2,327,128.18 | |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 51,676 | 69.360 | 3,584,247.36 | |
| ELEVANCE HEALTH INC | 20,124 | 553.500 | 11,138,634.00 | |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGY | 35,095 | 86.640 | 3,040,630.80 | |
| HCA HEALTHCARE INC | 16,659 | 403.430 | 6,720,740.37 | |
| HENRY SCHEIN INC | 10,457 | 69.870 | 730,630.59 | |
| HOLOGIC INC | 19,730 | 82.700 | 1,631,671.00 | |
| HUMANA INC | 10,475 | 315.230 | 3,302,034.25 | |
| IDEXX LABORATORIES INC | 7,376 | 511.380 | 3,771,938.88 | |
| INSULET CORP | 5,082 | 233.890 | 1,188,628.98 | |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 30,598 | 491.390 | 15,035,551.22 | |
| LABCORP HOLDINGS INC | 7,903 | 225.760 | 1,784,181.28 | |
| MCKESSON CORP | 10,903 | 519.820 | 5,667,597.46 | |
| MEDTRONIC PLC | 110,600 | 90.110 | 9,966,166.00 | |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 4,673 | 360.770 | 1,685,878.21 | |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 9,647 | 156.360 | 1,508,404.92 | |
| RESMED INC | 12,536 | 251.770 | 3,156,188.72 | |
| SOLVENTUM CORP | 10,620 | 71.790 | 762,409.80 | |
| STERIS PLC | 9,126 | 243.730 | 2,224,279.98 | |
| STRYKER CORP | 29,004 | 371.960 | 10,788,327.84 | |
| TELEFLEX INC | 3,952 | 246.050 | 972,389.60 | |
| THE CIGNA GROUP | 23,734 | 366.850 | 8,706,817.90 | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 78,512 | 589.140 | 46,254,559.68 | |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 5,785 | 234.990 | 1,359,417.15 | |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 12,279 | 217.030 | 2,664,911.37 | |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 18,219 | 107.430 | 1,957,267.17 | |
| ABBVIE INC | 150,635 | 195.730 | 29,483,788.55 | |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 25,379 | 138.310 | 3,510,169.49 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 11,014 | 270.370 | 2,977,855.18 | |
| AMGEN INC | 46,259 | 335.260 | 15,508,792.34 | |
| AVANTOR INC | 56,039 | 27.200 | 1,524,260.80 | |
| BIOGEN INC | 12,779 | 199.580 | 2,550,432.82 | |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 18,017 | 69.860 | 1,258,667.62 | |
| BIO-RAD LABORATORIES-A | 1,728 | 330.260 | 570,689.28 | |
| BIO-TECHNE CORP | 13,296 | 74.760 | 994,008.96 | |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 170,214 | 49.990 | 8,508,997.86 | |
| CATALENT INC | 16,025 | 60.160 | 964,064.00 | |
| CHARLES RIVER LABORATORIES | 4,795 | 203.730 | 976,885.35 | |
| DANAHER CORP | 57,483 | 276.030 | 15,867,032.49 | |
| ELI LILLY & CO | 68,957 | 923.540 | 63,684,547.78 | |
| EXACT SCIENCES CORP | 13,570 | 69.480 | 942,843.60 | |
| GILEAD SCIENCES INC | 104,725 | 83.160 | 8,708,931.00 | |
| ILLUMINA INC | 14,966 | 129.520 | 1,938,396.32 | |
| INCYTE CORP | 15,899 | 66.410 | 1,055,852.59 | |
| IQVIA HOLDINGS INC | 15,286 | 239.380 | 3,659,162.68 | |
| JOHNSON & JOHNSON | 205,298 | 166.990 | 34,282,713.02 | |
| MERCK & CO. INC. | 216,057 | 117.960 | 25,486,083.72 | |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 1,813 | 1,393.250 | 2,525,962.25 | |
| MODERNA INC | 27,369 | 69.170 | 1,893,113.73 | |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 8,744 | 122.250 | 1,068,954.00 | |
| PFIZER INC | 489,096 | 30.070 | 14,707,116.72 | |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 9,121 | 1,153.080 | 10,517,242.68 | |
| REVVITY INC | 10,411 | 122.800 | 1,278,470.80 | |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A | 27,162 | 28.260 | 767,598.12 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 102,259 | 18.070 | 1,847,820.13 | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 32,830 | 614.150 | 20,162,544.50 | |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 3,537 | 344.980 | 1,220,194.26 | |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 21,794 | 489.430 | 10,666,637.42 | |
| VIATRIS INC | 99,736 | 11.810 | 1,177,882.16 | |
| WATERS CORP | 5,084 | 328.650 | 1,670,856.60 | |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 6,204 | 296.780 | 1,841,223.12 | |
| ZOETIS INC | 38,410 | 194.250 | 7,461,142.50 | |
| BANK OF AMERICA CORP | 596,414 | 39.100 | 23,319,787.40 | |
| CITIGROUP INC | 160,852 | 58.390 | 9,392,148.28 | |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 36,122 | 40.600 | 1,466,553.20 | |
| FIFTH THIRD BANCORP | 58,586 | 42.380 | 2,482,874.68 | |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A | 845 | 1,871.320 | 1,581,265.40 | |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 128,600 | 14.640 | 1,882,704.00 | |
| JPMORGAN CHASE & CO | 245,020 | 207.860 | 50,929,857.20 | |
| KEYCORP | 84,828 | 16.270 | 1,380,151.56 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| M & T BANK CORP | 14,423 | 173.080 | 2,496,332.84 | |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 34,855 | 180.920 | 6,305,966.60 | |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 79,089 | 22.300 | 1,763,684.70 | |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 110,627 | 42.130 | 4,660,715.51 | |
| US BANCORP | 129,406 | 44.690 | 5,783,154.14 | |
| WELLS FARGO & CO | 297,335 | 53.790 | 15,993,649.65 | |
| ALLY FINANCIAL INC | 20,139 | 33.030 | 665,191.17 | |
| AMERICAN EXPRESS CO | 49,743 | 261.090 | 12,987,399.87 | |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 8,870 | 445.140 | 3,948,391.80 | |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 34,367 | 117.160 | 4,026,437.72 | |
| ARES MANAGEMENT CORP - A | 16,991 | 149.390 | 2,538,285.49 | |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 61,100 | 70.530 | 4,309,383.00 | |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 113,330 | 451.780 | 51,200,227.40 | |
| BLACKROCK INC | 12,569 | 895.180 | 11,251,517.42 | |
| BLACKSTONE INC | 60,652 | 154.560 | 9,374,373.12 | |
| BLOCK INC | 49,568 | 65.780 | 3,260,583.04 | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 32,018 | 140.950 | 4,512,937.10 | |
| CARLYLE GROUP INC/THE | 16,730 | 41.080 | 687,268.40 | |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 9,059 | 212.610 | 1,926,033.99 | |
| CME GROUP INC | 30,011 | 218.530 | 6,558,303.83 | |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A | 16,066 | 161.500 | 2,594,659.00 | |
| COREBRIDGE FINANCIAL INC | 19,925 | 27.180 | 541,561.50 | |
| CORPAY INC | 6,278 | 307.630 | 1,931,301.14 | |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 21,512 | 133.910 | 2,880,671.92 | |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 31,450 | 40.780 | 1,282,531.00 | |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 2,946 | 453.980 | 1,337,425.08 | |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 47,604 | 85.030 | 4,047,768.12 | |
| FISERV INC | 49,889 | 175.350 | 8,748,036.15 | |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 21,778 | 20.110 | 437,955.58 | |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR | 4,784 | 57.540 | 275,271.36 | |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 20,594 | 111.050 | 2,286,963.70 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 27,281 | 485.160 | 13,235,649.96 | |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 48,090 | 161.910 | 7,786,251.90 | |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 6,120 | 177.060 | 1,083,607.20 | |
| KKR & CO INC | 54,340 | 126.540 | 6,876,183.60 | |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC | 6,164 | 208.140 | 1,282,974.96 | |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 2,653 | 259.000 | 687,127.00 | |
| MASTERCARD INC - A | 71,169 | 497.710 | 35,421,522.99 | |
| MOODY'S CORP | 13,799 | 484.840 | 6,690,307.16 | |
| MORGAN STANLEY | 103,002 | 100.090 | 10,309,470.18 | |
| MSCI INC | 6,799 | 566.660 | 3,852,721.34 | |
| NASDAQ INC | 36,003 | 73.300 | 2,639,019.90 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| NORTHERN TRUST CORP | 16,793 | 89.750 | 1,507,171.75 | |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 85,759 | 71.070 | 6,094,892.13 | |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 17,112 | 119.730 | 2,048,819.76 | |
| ROBINHOOD MARKETS INC - A | 50,779 | 22.210 | 1,127,801.59 | |
| S&P GLOBAL INC | 27,631 | 527.380 | 14,572,036.78 | |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 131,436 | 63.690 | 8,371,158.84 | |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 7,550 | 67.480 | 509,474.00 | |
| STATE STREET CORP | 25,474 | 85.460 | 2,177,008.04 | |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 32,112 | 47.330 | 1,519,860.96 | |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 20,577 | 105.865 | 2,178,384.10 | |
| TOAST INC-CLASS A | 35,993 | 26.570 | 956,334.01 | |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 8,688 | 119.550 | 1,038,650.40 | |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 134,891 | 290.480 | 39,183,137.68 | |
| AFLAC INC | 44,628 | 110.170 | 4,916,666.76 | |
| ALLSTATE CORP | 22,831 | 190.560 | 4,350,675.36 | |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 4,866 | 136.120 | 662,359.92 | |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 55,264 | 73.000 | 4,034,272.00 | |
| AON PLC-CLASS A | 16,323 | 350.690 | 5,724,312.87 | |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 32,647 | 114.220 | 3,728,940.34 | |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 18,202 | 299.550 | 5,452,409.10 | |
| ASSURANT INC | 4,977 | 192.920 | 960,162.84 | |
| BROWN & BROWN INC | 20,402 | 104.110 | 2,124,052.22 | |
| CHUBB LTD | 33,496 | 291.320 | 9,758,054.72 | |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 13,251 | 137.180 | 1,817,772.18 | |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 2,244 | 527.900 | 1,184,607.60 | |
| EVEREST GROUP LTD | 3,547 | 389.430 | 1,381,308.21 | |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL | 24,937 | 60.610 | 1,511,431.57 | |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 25,592 | 116.630 | 2,984,794.96 | |
| LOEWS CORP | 16,971 | 78.840 | 1,337,993.64 | |
| MARKEL GROUP INC | 1,175 | 1,574.830 | 1,850,425.25 | |
| MARSH & MCLENNAN COS | 41,510 | 231.170 | 9,595,866.70 | |
| METLIFE INC | 52,395 | 77.380 | 4,054,325.10 | |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 19,458 | 82.170 | 1,598,863.86 | |
| PROGRESSIVE CORP | 50,624 | 256.310 | 12,975,437.44 | |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 32,008 | 117.730 | 3,768,301.84 | |
| TRAVELERS COS INC/THE | 19,523 | 242.260 | 4,729,641.98 | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 8,848 | 293.970 | 2,601,046.56 | |
| WR BERKLEY CORP | 27,229 | 58.750 | 1,599,703.75 | |
| ACCENTURE PLC-CL A | 53,920 | 354.120 | 19,094,150.40 | |
| ADOBE INC | 37,625 | 521.500 | 19,621,437.50 | |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 13,226 | 99.290 | 1,313,209.54 | |
| ANSYS INC | 7,892 | 318.050 | 2,510,050.60 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| APPLOVIN CORP-CLASS A | 19,293 | 116.250 | 2,242,811.25 | |
| ASPEN TECHNOLOGY INC | 1,901 | 226.100 | 429,816.10 | |
| ATLASSIAN CORP-CL A | 12,421 | 165.150 | 2,051,328.15 | |
| AUTODESK INC | 19,029 | 267.730 | 5,094,634.17 | |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B | 15,779 | 49.360 | 778,851.44 | |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 22,681 | 273.130 | 6,194,861.53 | |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | 8,287 | 192.970 | 1,599,142.39 | |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A | 27,192 | 79.930 | 2,173,456.56 | |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 41,604 | 77.870 | 3,239,703.48 | |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 19,060 | 267.810 | 5,104,458.60 | |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 4,025 | 273.400 | 1,100,435.00 | |
| DATADOG INC - CLASS A | 22,908 | 111.400 | 2,551,951.20 | |
| DOCUSIGN INC | 17,164 | 56.760 | 974,228.64 | |
| DYNATRACE INC | 21,256 | 51.550 | 1,095,746.80 | |
| EPAM SYSTEMS INC | 4,815 | 205.460 | 989,289.90 | |
| FAIR ISAAC CORP | 2,176 | 1,894.980 | 4,123,476.48 | |
| FORTINET INC | 52,961 | 76.340 | 4,043,042.74 | |
| GARTNER INC | 6,537 | 510.080 | 3,334,392.96 | |
| GEN DIGITAL INC | 41,779 | 26.620 | 1,112,156.98 | |
| GODADDY INC - CLASS A | 11,895 | 150.300 | 1,787,818.50 | |
| HUBSPOT INC | 3,878 | 495.410 | 1,921,199.98 | |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 79,188 | 217.160 | 17,196,466.08 | |
| INTUIT INC | 24,113 | 646.250 | 15,583,026.25 | |
| MANHATTAN ASSOCIATES INC | 4,648 | 270.400 | 1,256,819.20 | |
| MICROSOFT CORP | 602,701 | 431.340 | 259,969,049.34 | |
| MICROSTRATEGY INC-CL A | 14,020 | 134.530 | 1,886,110.60 | |
| MONDAY.COM LTD | 3,167 | 263.130 | 833,332.71 | |
| MONGODB INC | 5,921 | 290.050 | 1,717,386.05 | |
| OKTA INC | 13,914 | 74.030 | 1,030,053.42 | |
| ORACLE CORP | 142,145 | 170.330 | 24,211,557.85 | |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A | 178,162 | 36.310 | 6,469,062.22 | |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 27,325 | 346.110 | 9,457,455.75 | |
| PTC INC | 9,246 | 173.760 | 1,606,584.96 | |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 8,988 | 556.560 | 5,002,361.28 | |
| SALESFORCE INC | 82,659 | 256.910 | 21,235,923.69 | |
| SAMSARA INC-CL A | 13,749 | 46.940 | 645,378.06 | |
| SERVICENOW INC | 17,689 | 892.460 | 15,786,724.94 | |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A | 24,978 | 112.840 | 2,818,517.52 | |
| SYNOPSYS INC | 12,929 | 498.570 | 6,446,011.53 | |
| TWILIO INC - A | 15,028 | 60.300 | 906,188.40 | |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 3,550 | 585.730 | 2,079,341.50 | |
| VERISIGN INC | 7,316 | 182.460 | 1,334,877.36 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| WIX.COM LTD | 3,881 | 156.590 | 607,725.79 | |
| WORKDAY INC-CLASS A | 18,596 | 249.210 | 4,634,309.16 | |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A | 23,688 | 67.620 | 1,601,782.56 | |
| ZSCALER INC | 7,508 | 171.780 | 1,289,724.24 | |
| AMPHENOL CORP-CL A | 102,192 | 63.270 | 6,465,687.84 | |
| APPLE INC | 1,243,373 | 216.320 | 268,966,447.36 | |
| ARISTA NETWORKS INC | 22,318 | 359.160 | 8,015,732.88 | |
| CDW CORP/DE | 10,704 | 221.450 | 2,370,400.80 | |
| CISCO SYSTEMS INC | 346,969 | 51.030 | 17,705,828.07 | |
| CORNING INC | 64,764 | 42.910 | 2,779,023.24 | |
| DELL TECHNOLOGIES -C | 25,479 | 115.400 | 2,940,276.60 | |
| F5 INC | 4,939 | 213.420 | 1,054,081.38 | |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 102,647 | 17.230 | 1,768,607.81 | |
| HP INC | 85,880 | 33.760 | 2,899,308.80 | |
| JABIL INC | 9,808 | 105.720 | 1,036,901.76 | |
| JUNIPER NETWORKS INC | 30,061 | 38.630 | 1,161,256.43 | |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN | 15,964 | 149.480 | 2,386,298.72 | |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 13,944 | 443.180 | 6,179,701.92 | |
| NETAPP INC | 17,045 | 117.860 | 2,008,923.70 | |
| PURE STORAGE INC - CLASS A | 28,039 | 49.580 | 1,390,173.62 | |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS | 15,879 | 101.440 | 1,610,765.76 | |
| SUPER MICRO COMPUTER INC | 4,557 | 449.100 | 2,046,548.70 | |
| TE CONNECTIVITY LTD | 25,716 | 145.880 | 3,751,450.08 | |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 4,328 | 429.140 | 1,857,317.92 | |
| TRIMBLE INC | 20,783 | 58.410 | 1,213,935.03 | |
| WESTERN DIGITAL CORP | 29,044 | 64.090 | 1,861,429.96 | |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 4,189 | 343.790 | 1,440,136.31 | |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 139,000 | 152.080 | 21,139,120.00 | |
| ANALOG DEVICES INC | 43,053 | 223.280 | 9,612,873.84 | |
| APPLIED MATERIALS INC | 69,692 | 187.580 | 13,072,825.36 | |
| BROADCOM INC | 378,262 | 164.020 | 62,042,533.24 | |
| ENPHASE ENERGY INC | 10,381 | 111.490 | 1,157,377.69 | |
| ENTEGRIS INC | 12,569 | 110.150 | 1,384,475.35 | |
| FIRST SOLAR INC | 8,882 | 233.310 | 2,072,259.42 | |
| INTEL CORP | 358,536 | 20.910 | 7,496,987.76 | |
| KLA CORP | 11,357 | 736.400 | 8,363,294.80 | |
| LAM RESEARCH CORP | 11,046 | 758.470 | 8,378,059.62 | |
| MARVELL TECHNOLOGY INC | 75,550 | 73.400 | 5,545,370.00 | |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 44,600 | 77.000 | 3,434,200.00 | |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 93,001 | 87.180 | 8,107,827.18 | |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 4,028 | 885.230 | 3,565,706.44 | |
| NVIDIA CORP | 2,099,584 | 116.780 | 245,189,419.52 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 22,287 | 230.010 | 5,126,232.87 | |
| ON SEMICONDUCTOR | 35,773 | 70.370 | 2,517,346.01 | |
| QORVO INC | 7,835 | 100.460 | 787,104.10 | |
| QUALCOMM INC | 96,155 | 166.610 | 16,020,384.55 | |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 13,506 | 97.250 | 1,313,458.50 | |
| TERADYNE INC | 12,464 | 127.980 | 1,595,142.72 | |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 78,458 | 198.470 | 15,571,559.26 | |
| AT&T INC | 619,933 | 22.270 | 13,805,907.91 | |
| T-MOBILE US INC | 45,251 | 205.850 | 9,314,918.35 | |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 363,026 | 45.000 | 16,336,170.00 | |
| AES CORP | 54,086 | 19.010 | 1,028,174.86 | |
| ALLIANT ENERGY CORP | 21,204 | 60.510 | 1,283,054.04 | |
| AMEREN CORPORATION | 22,382 | 85.470 | 1,912,989.54 | |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 43,705 | 104.950 | 4,586,839.75 | |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 17,778 | 149.090 | 2,650,522.02 | |
| ATMOS ENERGY CORP | 13,505 | 138.270 | 1,867,336.35 | |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 54,717 | 28.210 | 1,543,566.57 | |
| CMS ENERGY CORP | 27,913 | 70.480 | 1,967,308.24 | |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 28,772 | 104.850 | 3,016,744.20 | |
| CONSTELLATION ENERGY | 26,817 | 199.250 | 5,343,287.25 | |
| DOMINION ENERGY INC | 72,436 | 58.530 | 4,239,679.08 | |
| DTE ENERGY COMPANY | 18,974 | 126.360 | 2,397,554.64 | |
| DUKE ENERGY CORP | 65,574 | 117.700 | 7,718,059.80 | |
| EDISON INTERNATIONAL | 32,299 | 86.250 | 2,785,788.75 | |
| ENTERGY CORP | 17,246 | 128.460 | 2,215,421.16 | |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 25,795 | 39.470 | 1,018,128.65 | |
| EVERGY INC | 22,411 | 62.010 | 1,389,706.11 | |
| EVERSOURCE ENERGY | 30,845 | 68.400 | 2,109,798.00 | |
| EXELON CORP | 84,941 | 40.430 | 3,434,164.63 | |
| FIRSTENERGY CORP | 45,110 | 44.340 | 2,000,177.40 | |
| NEXTERA ENERGY INC | 176,613 | 84.640 | 14,948,524.32 | |
| NISOURCE INC | 34,855 | 34.380 | 1,198,314.90 | |
| NRG ENERGY INC | 18,864 | 80.780 | 1,523,833.92 | |
| P G & E CORP | 174,106 | 20.010 | 3,483,861.06 | |
| PPL CORP | 61,956 | 32.680 | 2,024,722.08 | |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 42,789 | 84.770 | 3,627,223.53 | |
| SEMPRA | 53,312 | 83.600 | 4,456,883.20 | |
| SOUTHERN CO/THE | 92,045 | 89.890 | 8,273,925.05 | |
| VISTRA CORP | 29,322 | 89.400 | 2,621,386.80 | |
| WEC ENERGY GROUP INC | 25,816 | 96.140 | 2,481,950.24 | |
| XCEL ENERGY INC | 45,776 | 64.560 | 2,955,298.56 | |
| ALPHABET INC-CL A | 501,072 | 158.060 | 79,199,440.32 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ALPHABET INC-CL C | 431,512 | 158.990 | 68,606,092.88 | |
| | CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 7,601 | 343.370 | 2,609,955.37 | |
| | COMCAST CORP-CLASS A | 333,137 | 39.360 | 13,112,272.32 | |
| | ELECTRONIC ARTS INC | 20,831 | 146.520 | 3,052,158.12 | |
| | FOX CORP - CLASS A | 23,886 | 39.710 | 948,513.06 | |
| | FOX CORP - CLASS B | 8,773 | 36.770 | 322,583.21 | |
| | INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 32,096 | 31.170 | 1,000,432.32 | |
| | LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C | 16,121 | 77.590 | 1,250,828.39 | |
| | LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 13,554 | 101.520 | 1,376,002.08 | |
| | MATCH GROUP INC | 24,529 | 35.180 | 862,930.22 | |
| | META PLATFORMS INC-CLASS A | 187,256 | 533.280 | 99,859,879.68 | |
| | NETFLIX INC | 36,998 | 696.500 | 25,769,107.00 | |
| | NEWS CORP - CLASS A | 34,405 | 26.090 | 897,626.45 | |
| | OMNICOM GROUP | 18,370 | 101.090 | 1,857,023.30 | |
| | PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B | 40,964 | 10.420 | 426,844.88 | |
| | PINTEREST INC- CLASS A | 48,115 | 28.890 | 1,390,042.35 | |
| | ROBLOX CORP -CLASS A | 37,893 | 46.240 | 1,752,172.32 | |
| | ROKU INC | 9,945 | 74.370 | 739,609.65 | |
| | SEA LTD-ADR | 31,577 | 79.880 | 2,522,370.76 | |
| | SNAP INC - A | 86,463 | 9.640 | 833,503.32 | |
| | TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE | 14,811 | 152.450 | 2,257,936.95 | |
| | TRADE DESK INC/THE -CLASS A | 36,722 | 105.370 | 3,869,397.14 | |
| | WALT DISNEY CO/THE | 154,051 | 91.850 | 14,149,584.35 | |
| | WARNER BROS DISCOVERY INC | 201,390 | 8.560 | 1,723,898.40 | |
| | CBRE GROUP INC - A | 27,148 | 119.500 | 3,244,186.00 | |
| | COSTAR GROUP INC | 33,292 | 77.900 | 2,593,446.80 | |
| | HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 79,100 | 3.680 | 291,088.00 | |
| | ZILLOW GROUP INC - C | 16,334 | 62.590 | 1,022,345.06 | |
| アメリカ・ドル小計 | | 31,226,060 | | 4,105,320,480.50<br>(577,905,964,040) | |
| カナダ・ドル | ARC RESOURCES LTD | 44,923 | 23.210 | 1,042,662.83 | |
| | CAMECO CORP | 33,586 | 55.100 | 1,850,588.60 | |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 186,016 | 43.930 | 8,171,682.88 | |
| | CENOVUS ENERGY INC | 120,048 | 22.360 | 2,684,273.28 | |
| | ENBRIDGE INC | 189,679 | 55.960 | 10,614,436.84 | |
| | IMPERIAL OIL LTD | 16,267 | 91.050 | 1,481,110.35 | |
| | KEYERA CORP | 19,802 | 41.140 | 814,654.28 | |
| | MEG ENERGY CORP | 21,651 | 24.640 | 533,480.64 | |
| | PARKLAND CORP | 16,066 | 34.510 | 554,437.66 | |
| | PEMBINA PIPELINE CORP | 45,973 | 55.320 | 2,543,226.36 | |
| | SUNCOR ENERGY INC | 108,809 | 49.920 | 5,431,745.28 | |
| | TC ENERGY CORP | 90,192 | 63.550 | 5,731,701.60 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | TOURMALINE OIL CORP | 26,107 | 59.110 | 1,543,184.77 | |
| | AGNICO EAGLE MINES LTD | 41,898 | 112.190 | 4,700,536.62 | |
| | BARRICK GOLD CORP | 157,839 | 27.880 | 4,400,551.32 | |
| | CCL INDUSTRIES INC - CL B | 13,268 | 81.470 | 1,080,943.96 | |
| | FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 68,446 | 16.770 | 1,147,839.42 | |
| | FRANCO-NEVADA CORP | 15,696 | 169.790 | 2,665,023.84 | |
| | IVANHOE MINES LTD-CL A | 56,432 | 17.840 | 1,006,746.88 | |
| | KINROSS GOLD CORP | 110,156 | 12.860 | 1,416,606.16 | |
| | LUNDIN MINING CORP | 46,446 | 12.480 | 579,646.08 | |
| | NUTRIEN LTD | 42,180 | 63.290 | 2,669,572.20 | |
| | PAN AMERICAN SILVER CORP | 25,157 | 28.880 | 726,534.16 | |
| | TECK RESOURCES LTD-CLS B | 40,547 | 63.950 | 2,592,980.65 | |
| | WEST FRASER TIMBER CO LTD | 4,438 | 124.800 | 553,862.40 | |
| | WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 40,353 | 84.600 | 3,413,863.80 | |
| | CAE INC | 27,474 | 23.950 | 658,002.30 | |
| | STANTEC INC | 9,939 | 107.730 | 1,070,728.47 | |
| | TOROMONT INDUSTRIES LTD | 6,027 | 128.970 | 777,302.19 | |
| | WSP GLOBAL INC | 11,089 | 233.250 | 2,586,509.25 | |
| | ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR | 32,674 | 28.320 | 925,327.68 | |
| | GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 15,630 | 54.590 | 853,241.70 | |
| | RB GLOBAL INC | 15,569 | 115.660 | 1,800,710.54 | |
| | THOMSON REUTERS CORP | 13,747 | 234.870 | 3,228,757.89 | |
| | AIR CANADA | 12,083 | 16.400 | 198,161.20 | |
| | CANADIAN NATL RAILWAY CO | 47,256 | 163.870 | 7,743,840.72 | |
| | CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY | 79,413 | 118.610 | 9,419,175.93 | |
| | TFI INTERNATIONAL INC | 6,995 | 196.610 | 1,375,286.95 | |
| | MAGNA INTERNATIONAL INC | 22,436 | 54.530 | 1,223,435.08 | |
| | BRP INC/CA- SUB VOTING | 3,082 | 82.190 | 253,309.58 | |
| | GILDAN ACTIVEWEAR INC | 11,302 | 61.920 | 699,819.84 | |
| | RESTAURANT BRANDS INTERN | 25,379 | 94.990 | 2,410,751.21 | |
| | CANADIAN TIRE CORP-CLASS A | 4,737 | 157.830 | 747,640.71 | |
| | DOLLARAMA INC | 24,084 | 136.480 | 3,286,984.32 | |
| | ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 64,619 | 75.750 | 4,894,889.25 | |
| | EMPIRE CO LTD 'A' | 9,148 | 39.760 | 363,724.48 | |
| | LOBLAW COMPANIES LTD | 14,057 | 180.800 | 2,541,505.60 | |
| | METRO INC/CN | 18,929 | 86.400 | 1,635,465.60 | |
| | WESTON (GEORGE) LTD | 4,984 | 226.680 | 1,129,773.12 | |
| | SAPUTO INC | 18,270 | 29.410 | 537,320.70 | |
| | BANK OF MONTREAL | 60,312 | 117.980 | 7,115,609.76 | |
| | BANK OF NOVA SCOTIA | 102,004 | 71.530 | 7,296,346.12 | |
| | CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 78,946 | 83.590 | 6,599,096.14 | |
| | NATIONAL BANK OF CANADA | 29,961 | 126.880 | 3,801,451.68 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ROYAL BANK OF CANADA | 122,095 | 167.580 | 20,460,680.10 | |
| | TORONTO-DOMINION BANK | 149,615 | 85.490 | 12,790,586.35 | |
| | BROOKFIELD ASSET MGMT-A | 31,451 | 61.410 | 1,931,405.91 | |
| | BROOKFIELD CORP | 113,931 | 68.500 | 7,804,273.50 | |
| | IGM FINANCIAL INC | 4,949 | 39.120 | 193,604.88 | |
| | ONEX CORPORATION | 4,217 | 91.170 | 384,463.89 | |
| | TMX GROUP LTD | 26,034 | 43.700 | 1,137,685.80 | |
| | FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 1,745 | 1,684.980 | 2,940,290.10 | |
| | GREAT-WEST LIFECO INC | 22,964 | 45.520 | 1,045,321.28 | |
| | IA FINANCIAL CORP INC | 8,268 | 105.930 | 875,829.24 | |
| | INTACT FINANCIAL CORP | 16,097 | 254.610 | 4,098,457.17 | |
| | MANULIFE FINANCIAL CORP | 158,627 | 38.440 | 6,097,621.88 | |
| | POWER CORP OF CANADA | 50,268 | 42.350 | 2,128,849.80 | |
| | SUN LIFE FINANCIAL INC | 46,259 | 76.810 | 3,553,153.79 | |
| | CGI INC | 18,609 | 157.660 | 2,933,894.94 | |
| | CONSTELLATION SOFTWARE INC | 1,727 | 4,355.410 | 7,521,793.07 | |
| | DESCARTES SYSTEMS GRP/THE | 6,424 | 135.440 | 870,066.56 | |
| | OPEN TEXT CORP | 21,507 | 43.670 | 939,210.69 | |
| | SHOPIFY INC - CLASS A | 104,152 | 99.980 | 10,413,116.96 | |
| | BCE INC | 8,653 | 46.710 | 404,181.63 | |
| | QUEBECOR INC -CL B | 14,578 | 34.550 | 503,669.90 | |
| | ROGERS COMMUNICATIONS INC-B | 32,571 | 55.620 | 1,811,599.02 | |
| | TELUS CORP | 15,222 | 23.030 | 350,562.66 | |
| | ALTAGAS LTD | 27,309 | 35.310 | 964,280.79 | |
| | BROOKFIELD RENEWABLE COR-A | 11,200 | 41.240 | 461,888.00 | |
| | CANADIAN UTILITIES LTD-A | 7,344 | 35.890 | 263,576.16 | |
| | EMERA INC | 22,591 | 53.360 | 1,205,455.76 | |
| | FORTIS INC | 41,868 | 61.990 | 2,595,397.32 | |
| | HYDRO ONE LTD | 33,037 | 47.940 | 1,583,793.78 | |
| | FIRSTSERVICE CORP | 3,669 | 245.830 | 901,950.27 | |
| カナダ・ドル小計 | | 3,479,102 | | 244,292,722.07<br>(25,298,954,298) | |
| オーストラリア・ドル | AMPOL LTD | 19,016 | 28.930 | 550,132.88 | |
| | SANTOS LTD | 278,806 | 7.000 | 1,951,642.00 | |
| | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD | 162,029 | 24.100 | 3,904,898.90 | |
| | BHP GROUP LTD | 438,420 | 39.550 | 17,339,511.00 | |
| | BLUESCOPE STEEL LTD | 37,214 | 20.050 | 746,140.70 | |
| | FORTESCUE LTD | 135,233 | 17.190 | 2,324,655.27 | |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI | 36,927 | 53.220 | 1,965,254.94 | |
| | MINERAL RESOURCES LTD | 17,115 | 38.270 | 654,991.05 | |
| | NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 92,960 | 15.830 | 1,471,556.80 | |
| | ORICA LTD | 36,212 | 17.640 | 638,779.68 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | PILBARA MINERALS LTD | 280,194 | 2.880 | 806,958.72 | |
| | RIO TINTO LTD | 32,627 | 110.810 | 3,615,397.87 | |
| | SOUTH32 LTD | 336,639 | 3.170 | 1,067,145.63 | |
| | REECE LTD | 13,059 | 27.950 | 364,999.05 | |
| | SEVEN GROUP HOLDINGS LTD | 16,425 | 41.890 | 688,043.25 | |
| | BRAMBLES LTD | 122,717 | 18.540 | 2,275,173.18 | |
| | COMPUTERSHARE LTD | 50,853 | 27.730 | 1,410,153.69 | |
| | QANTAS AIRWAYS LTD | 78,226 | 7.030 | 549,928.78 | |
| | ARISTOCRAT LEISURE LTD | 47,081 | 55.930 | 2,633,240.33 | |
| | LOTTERY CORP LTD/THE | 173,268 | 5.120 | 887,132.16 | |
| | WESFARMERS LTD | 96,169 | 70.580 | 6,787,608.02 | |
| | COLES GROUP LTD | 111,645 | 19.030 | 2,124,604.35 | |
| | ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI | 138,738 | 5.050 | 700,626.90 | |
| | WOOLWORTHS GROUP LTD | 107,180 | 35.120 | 3,764,161.60 | |
| | TREASURY WINE ESTATES LTD | 62,913 | 11.140 | 700,850.82 | |
| | COCHLEAR LTD | 5,404 | 290.070 | 1,567,538.28 | |
| | PRO MEDICUS LTD | 5,586 | 162.170 | 905,881.62 | |
| | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 14,565 | 40.350 | 587,697.75 | |
| | SONIC HEALTHCARE LTD | 37,362 | 27.190 | 1,015,872.78 | |
| | CSL LTD | 41,471 | 296.690 | 12,304,030.99 | |
| | ANZ GROUP HOLDINGS LTD | 253,422 | 31.200 | 7,906,766.40 | |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 143,830 | 142.990 | 20,566,251.70 | |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 264,499 | 38.780 | 10,257,271.22 | |
| | WESTPAC BANKING CORP | 303,158 | 32.790 | 9,940,550.82 | |
| | ASX LTD | 15,385 | 64.010 | 984,793.85 | |
| | MACQUARIE GROUP LTD | 31,658 | 228.400 | 7,230,687.20 | |
| | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 22,786 | 33.470 | 762,647.42 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 173,755 | 7.750 | 1,346,601.25 | |
| | MEDIBANK PRIVATE LTD | 193,702 | 3.800 | 736,067.60 | |
| | QBE INSURANCE GROUP LTD | 124,450 | 16.670 | 2,074,581.50 | |
| | SUNCORP GROUP LTD | 117,223 | 18.260 | 2,140,491.98 | |
| | WISETECH GLOBAL LTD | 14,590 | 131.450 | 1,917,855.50 | |
| | XERO LTD | 12,671 | 144.400 | 1,829,692.40 | |
| | TELSTRA GROUP LTD | 367,025 | 4.010 | 1,471,770.25 | |
| | ORIGIN ENERGY LTD | 134,865 | 9.550 | 1,287,960.75 | |
| | CAR GROUP LTD | 27,943 | 36.850 | 1,029,699.55 | |
| | REA GROUP LTD | 3,813 | 201.640 | 768,853.32 | |
| | SEEK LTD | 29,833 | 22.750 | 678,700.75 | |
| オーストラリア・ドル小計 | | 5,260,662 | | 149,235,852.45<br>(14,160,990,039) | |
| 香港・ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 235,424 | 41.900 | 9,864,265.60 | |
| | SWIRE PACIFIC LTD - CL A | 27,000 | 62.250 | 1,680,750.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 121,500 | 108.900 | 13,231,350.00 | |
| | MTR CORP | 118,500 | 26.950 | 3,193,575.00 | |
| | SITC INTERNATIONAL HOLDINGS | 160,000 | 18.800 | 3,008,000.00 | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 176,000 | 28.350 | 4,989,600.00 | |
| | SANDS CHINA LTD | 238,000 | 14.000 | 3,332,000.00 | |
| | WH GROUP LTD | 722,000 | 5.880 | 4,245,360.00 | |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 247,000 | 23.450 | 5,792,150.00 | |
| | HANG SENG BANK LTD | 63,400 | 90.150 | 5,715,510.00 | |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 102,400 | 221.200 | 22,650,880.00 | |
| | AIA GROUP LTD | 971,200 | 54.750 | 53,173,200.00 | |
| | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 62,000 | 57.050 | 3,537,100.00 | |
| | CLP HOLDINGS LTD | 142,100 | 70.400 | 10,003,840.00 | |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 861,389 | 6.310 | 5,435,364.59 | |
| | POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 111,000 | 54.150 | 6,010,650.00 | |
| | CK ASSET HOLDINGS LTD | 160,924 | 30.800 | 4,956,459.20 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 90,384 | 23.800 | 2,151,139.20 | |
| | SINO LAND CO | 248,200 | 8.040 | 1,995,528.00 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 135,500 | 79.000 | 10,704,500.00 | |
| | WHARF HOLDINGS LTD | 113,000 | 19.200 | 2,169,600.00 | |
| | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 125,000 | 21.950 | 2,743,750.00 | |
| 香港・ドル小計 | | 5,231,921 | | 180,584,571.59<br>(3,261,357,363) | |
| シンガポール・ドル | KEPPEL LTD | 115,000 | 6.330 | 727,950.00 | |
| | SINGAPORE TECH ENGINEERING | 108,600 | 4.620 | 501,732.00 | |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 113,566 | 6.500 | 738,179.00 | |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 675,000 | 0.840 | 567,000.00 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 159,600 | 3.140 | 501,144.00 | |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 170,270 | 38.000 | 6,470,260.00 | |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 295,500 | 15.230 | 4,500,465.00 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 102,400 | 32.280 | 3,305,472.00 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 65,200 | 11.110 | 724,372.00 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 673,815 | 3.290 | 2,216,851.35 | |
| | SEMBCORP INDUSTRIES LTD | 89,200 | 5.130 | 457,596.00 | |
| | CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | 220,100 | 2.910 | 640,491.00 | |
| シンガポール・ドル小計 | | 2,788,251 | | 21,351,512.35<br>(2,318,560,726) | |
| ニュージーランド・ドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 133,941 | 7.540 | 1,009,915.14 | |
| | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 46,548 | 38.400 | 1,787,443.20 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 121,519 | 3.360 | 408,303.84 | |
| | MERCURY NZ LTD | 81,489 | 5.950 | 484,859.55 | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 102,546 | 6.140 | 629,632.44 | |
| ニュージーランド・ドル小計 | | 486,043 | | 4,320,154.17 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | (376,155,824) | |
| イギリス・ポンド | BP PLC | 1,415,483 | 4.061 | 5,748,276.46 | |
| | SHELL PLC | 541,087 | 25.385 | 13,735,493.49 | |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 104,777 | 20.995 | 2,199,793.11 | |
| | ANTOFAGASTA PLC | 30,983 | 17.615 | 545,765.54 | |
| | CRODA INTERNATIONAL PLC | 10,296 | 39.610 | 407,824.56 | |
| | ENDEAVOUR MINING PLC | 17,507 | 18.350 | 321,253.45 | |
| | GLENCORE PLC | 869,792 | 3.777 | 3,285,204.38 | |
| | MONDI PLC | 45,625 | 14.025 | 639,890.62 | |
| | RIO TINTO PLC | 95,791 | 47.740 | 4,573,062.34 | |
| | ASHTEAD GROUP PLC | 35,259 | 53.460 | 1,884,946.14 | |
| | BAE SYSTEMS PLC | 267,719 | 13.355 | 3,575,387.24 | |
| | BUNZL PLC | 26,105 | 36.720 | 958,575.60 | |
| | DCC PLC | 10,153 | 52.650 | 534,555.45 | |
| | MELROSE INDUSTRIES PLC | 119,456 | 4.672 | 558,098.43 | |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 712,449 | 4.958 | 3,532,322.14 | |
| | SMITHS GROUP PLC | 36,853 | 18.160 | 669,250.48 | |
| | SPIRAX GROUP PLC | 5,904 | 73.650 | 434,829.60 | |
| | EXPERIAN PLC | 81,296 | 37.730 | 3,067,298.08 | |
| | INTERTEK GROUP PLC | 11,884 | 50.350 | 598,359.40 | |
| | RELX PLC | 159,389 | 36.400 | 5,801,759.60 | |
| | RENTOKIL INITIAL PLC | 190,467 | 3.758 | 715,774.98 | |
| | BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 139,211 | 5.084 | 707,748.72 | |
| | BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE | 10,362 | 48.830 | 505,976.46 | |
| | PERSIMMON PLC | 27,665 | 16.540 | 457,579.10 | |
| | TAYLOR WIMPEY PLC | 353,772 | 1.655 | 585,492.66 | |
| | COMPASS GROUP PLC | 137,977 | 24.600 | 3,394,234.20 | |
| | ENTAIN PLC | 42,158 | 7.256 | 305,898.44 | |
| | INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 14,491 | 78.500 | 1,137,543.50 | |
| | PEARSON PLC | 46,942 | 10.575 | 496,411.65 | |
| | WHITBREAD PLC | 16,522 | 30.630 | 506,068.86 | |
| | JD SPORTS FASHION PLC | 251,482 | 1.543 | 388,036.72 | |
| | KINGFISHER PLC | 179,593 | 2.903 | 521,358.47 | |
| | NEXT PLC | 9,030 | 104.100 | 940,023.00 | |
| | SAINSBURY (J) PLC | 113,480 | 2.946 | 334,312.08 | |
| | TESCO PLC | 623,187 | 3.706 | 2,309,531.02 | |
| | ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 30,992 | 22.320 | 691,741.44 | |
| | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 167,558 | 29.700 | 4,976,472.60 | |
| | COCA-COLA HBC AG-DI | 17,866 | 28.020 | 500,605.32 | |
| | DIAGEO PLC | 189,203 | 24.660 | 4,665,745.98 | |
| | IMPERIAL BRANDS PLC | 69,831 | 22.410 | 1,564,912.71 | |
| | HALEON PLC | 656,454 | 3.940 | 2,586,428.76 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 56,558 | 45.850 | 2,593,184.30 | |
| | UNILEVER PLC | 214,792 | 49.500 | 10,632,204.00 | |
| | NMC HEALTH PLC | 3,940 | 0.010 | 39.40 | |
| | SMITH & NEPHEW PLC | 85,977 | 11.900 | 1,023,126.30 | |
| | ASTRAZENECA PLC | 132,243 | 120.160 | 15,890,318.88 | |
| | GSK PLC | 352,557 | 16.320 | 5,753,730.24 | |
| | HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 14,590 | 19.530 | 284,942.70 | |
| | BARCLAYS PLC | 1,314,907 | 2.210 | 2,905,944.47 | |
| | HSBC HOLDINGS PLC | 1,585,380 | 6.547 | 10,379,482.86 | |
| | LLOYDS BANKING GROUP PLC | 5,165,051 | 0.581 | 3,000,894.63 | |
| | NATWEST GROUP PLC | 581,902 | 3.366 | 1,958,682.13 | |
| | STANDARD CHARTERED PLC | 182,397 | 7.594 | 1,385,122.81 | |
| | 3I GROUP PLC | 81,145 | 32.390 | 2,628,286.55 | |
| | HARGREAVES LANSDOWN PLC | 31,008 | 11.055 | 342,793.44 | |
| | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 41,416 | 105.000 | 4,348,680.00 | |
| | M&G PLC | 217,201 | 2.074 | 450,474.87 | |
| | SCHRODERS PLC | 61,711 | 3.382 | 208,706.60 | |
| | WISE PLC - A | 43,661 | 6.300 | 275,064.30 | |
| | ADMIRAL GROUP PLC | 19,808 | 28.900 | 572,451.20 | |
| | AVIVA PLC | 217,835 | 4.914 | 1,070,441.19 | |
| | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 561,409 | 2.266 | 1,272,152.79 | |
| | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | 59,286 | 5.460 | 323,701.56 | |
| | PRUDENTIAL PLC | 232,133 | 6.150 | 1,427,617.95 | |
| | SAGE GROUP PLC/THE | 75,045 | 10.175 | 763,582.87 | |
| | HALMA PLC | 32,277 | 26.000 | 839,202.00 | |
| | BT GROUP PLC | 540,623 | 1.475 | 797,418.92 | |
| | VODAFONE GROUP PLC | 1,981,261 | 0.784 | 1,553,308.62 | |
| | CENTRICA PLC | 527,715 | 1.171 | 617,954.26 | |
| | NATIONAL GRID PLC | 413,245 | 10.470 | 4,326,675.15 | |
| | SEVERN TRENT PLC | 20,117 | 26.890 | 540,946.13 | |
| | SSE PLC | 87,793 | 19.935 | 1,750,153.45 | |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 51,208 | 10.560 | 540,756.48 | |
| | AUTO TRADER GROUP PLC | 77,901 | 8.776 | 683,659.17 | |
| | INFORMA PLC | 105,332 | 8.466 | 891,740.71 | |
| | WPP PLC | 78,503 | 7.412 | 581,864.23 | |
| イギリス・ポンド小計 | | 23,133,978 | | 163,979,147.94<br>(30,473,884,852) | |
| イスラエル・シュケル | ICL GROUP LTD | 67,143 | 14.900 | 1,000,430.70 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 2,213 | 731.800 | 1,619,473.40 | |
| | BANK HAPOALIM BM | 98,327 | 34.970 | 3,438,495.19 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 135,088 | 33.470 | 4,521,395.36 | |
| | ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 118,638 | 19.560 | 2,320,559.28 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 11,916 | 136.400 | 1,625,342.40 | |
| | NICE LTD | 4,458 | 614.900 | 2,741,224.20 | |
| | AZRIELI GROUP LTD | 3,527 | 245.000 | 864,115.00 | |
| イスラエル・シュケル小計 | | 441,310 | | 18,131,035.53<br>(680,805,878) | |
| スイス・フラン | CLARIANT AG-REG | 28,111 | 12.370 | 347,733.07 | |
| | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 538 | 685.500 | 368,799.00 | |
| | GIVAUDAN-REG | 771 | 4,557.000 | 3,513,447.00 | |
| | HOLCIM LTD | 46,179 | 81.360 | 3,757,123.44 | |
| | SIG GROUP AG | 22,269 | 16.530 | 368,106.57 | |
| | SIKA AG-REG | 12,934 | 267.600 | 3,461,138.40 | |
| | ABB LTD-REG | 135,651 | 46.890 | 6,360,675.39 | |
| | GEBERIT AG-REG | 2,873 | 540.200 | 1,551,994.60 | |
| | SCHINDLER HOLDING AG-REG | 1,766 | 233.000 | 411,478.00 | |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 4,092 | 241.600 | 988,627.20 | |
| | VAT GROUP AG | 2,164 | 402.500 | 871,010.00 | |
| | ADECCO GROUP AG-REG | 14,810 | 27.080 | 401,054.80 | |
| | SGS SA-REG | 11,450 | 95.600 | 1,094,620.00 | |
| | KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG | 4,194 | 246.800 | 1,035,079.20 | |
| | CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 44,847 | 118.850 | 5,330,065.95 | |
| | SWATCH GROUP AG/THE-BR | 2,619 | 153.850 | 402,933.15 | |
| | SWATCH GROUP AG/THE-REG | 5,225 | 30.500 | 159,362.50 | |
| | AVOLTA AG | 8,656 | 32.580 | 282,012.48 | |
| | BARRY CALLEBAUT AG-REG | 382 | 1,456.000 | 556,192.00 | |
| | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC | 72 | 10,880.000 | 783,360.00 | |
| | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 8 | 106,200.000 | 849,600.00 | |
| | NESTLE SA-REG | 224,024 | 86.760 | 19,436,322.24 | |
| | ALCON INC | 41,643 | 83.340 | 3,470,527.62 | |
| | SONOVA HOLDING AG-REG | 4,173 | 303.500 | 1,266,505.50 | |
| | STRAUMANN HOLDING AG-REG | 8,823 | 123.050 | 1,085,670.15 | |
| | BACHEM HOLDING AG | 1,756 | 75.350 | 132,314.60 | |
| | GALDERMA GROUP AG | 4,744 | 79.640 | 377,812.16 | |
| | LONZA GROUP AG-REG | 6,471 | 550.800 | 3,564,226.80 | |
| | NOVARTIS AG-REG | 166,888 | 98.410 | 16,423,448.08 | |
| | ROCHE HOLDING AG-BR | 2,584 | 283.800 | 733,339.20 | |
| | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 60,422 | 264.100 | 15,957,450.20 | |
| | SANDOZ GROUP AG | 38,614 | 34.580 | 1,335,272.12 | |
| | BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 3,006 | 89.150 | 267,984.90 | |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 15,168 | 47.100 | 714,412.80 | |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 2,044 | 1,192.000 | 2,436,448.00 | |
| | UBS GROUP AG-REG | 285,835 | 25.070 | 7,165,883.45 | |
| | BALOISE HOLDING AG - REG | 3,909 | 169.700 | 663,357.30 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | HELVETIA HOLDING AG-REG | 4,111 | 137.100 | 563,618.10 | |
| | SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 2,277 | 699.800 | 1,593,444.60 | |
| | SWISS RE AG | 24,764 | 116.150 | 2,876,338.60 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 12,448 | 512.000 | 6,373,376.00 | |
| | TEMENOS AG - REG | 7,049 | 59.600 | 420,120.40 | |
| | LOGITECH INTERNATIONAL-REG | 13,555 | 72.500 | 982,737.50 | |
| | SWISSCOM AG-REG | 1,994 | 552.000 | 1,100,688.00 | |
| | BKW AG | 1,385 | 154.000 | 213,290.00 | |
| | SWISS PRIME SITE-REG | 7,190 | 96.650 | 694,913.50 | |
| スイス・フラン小計 | | 1,294,488 | | 122,743,914.57<br>(20,445,453,850) | |
| デンマーク・クローネ | NOVONESIS (NOVOZYMES) B | 30,327 | 467.800 | 14,186,970.60 | |
| | ROCKWOOL A/S-B SHS | 849 | 2,934.000 | 2,490,966.00 | |
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 86,250 | 159.150 | 13,726,687.50 | |
| | AP MOLLER-MAERSK A/S-A | 292 | 9,825.000 | 2,868,900.00 | |
| | AP MOLLER-MAERSK A/S-B | 412 | 10,110.000 | 4,165,320.00 | |
| | DSV A/S | 13,716 | 1,371.500 | 18,811,494.00 | |
| | PANDORA A/S | 7,823 | 1,190.500 | 9,313,281.50 | |
| | CARLSBERG AS-B | 8,080 | 794.200 | 6,417,136.00 | |
| | COLOPLAST-B | 10,365 | 942.000 | 9,763,830.00 | |
| | DEMANT A/S | 8,178 | 282.200 | 2,307,831.60 | |
| | GENMAB A/S | 5,493 | 1,776.500 | 9,758,314.50 | |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 275,286 | 922.100 | 253,841,220.60 | |
| | ZEALAND PHARMA A/S | 5,299 | 915.000 | 4,848,585.00 | |
| | DANSKE BANK A/S | 59,312 | 205.600 | 12,194,547.20 | |
| | TRYG A/S | 24,975 | 158.000 | 3,946,050.00 | |
| | ORSTED A/S | 14,988 | 442.500 | 6,632,190.00 | |
| デンマーク・クローネ小計 | | 551,645 | | 375,273,324.50<br>(7,873,234,348) | |
| ノルウェー・クローネ | AKER BP ASA | 27,948 | 229.800 | 6,422,450.40 | |
| | EQUINOR ASA | 69,048 | 267.900 | 18,497,959.20 | |
| | NORSK HYDRO ASA | 149,325 | 62.020 | 9,261,136.50 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 12,718 | 308.800 | 3,927,318.40 | |
| | KONGSBERG GRUPPEN ASA | 7,896 | 1,101.000 | 8,693,496.00 | |
| | MOWI ASA | 36,354 | 187.000 | 6,798,198.00 | |
| | ORKLA ASA | 63,195 | 99.500 | 6,287,902.50 | |
| | SALMAR ASA | 6,204 | 548.500 | 3,402,894.00 | |
| | DNB BANK ASA | 71,576 | 214.800 | 15,374,524.80 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 18,691 | 194.700 | 3,639,137.70 | |
| | TELENOR ASA | 48,435 | 135.600 | 6,567,786.00 | |
| ノルウェー・クローネ小計 | | 511,390 | | 88,872,803.50<br>(1,180,230,829) | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| スウェーデン・クローナ | BOLIDEN AB | 27,135 | 294.300 | 7,985,830.50 | |
| | HOLMEN AB-B SHARES | 7,024 | 425.200 | 2,986,604.80 | |
| | SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B | 45,662 | 143.800 | 6,566,195.60 | |
| | ADDTECH AB-B SHARES | 27,319 | 311.400 | 8,507,136.60 | |
| | ALFA LAVAL AB | 23,093 | 462.200 | 10,673,584.60 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 80,816 | 329.100 | 26,596,545.60 | |
| | ATLAS COPCO AB-A SHS | 235,332 | 178.600 | 42,030,295.20 | |
| | ATLAS COPCO AB-B SHS | 125,066 | 157.500 | 19,697,895.00 | |
| | BEIJER REF AB | 27,042 | 173.050 | 4,679,618.10 | |
| | EPIROC AB-A | 56,566 | 193.800 | 10,962,490.80 | |
| | EPIROC AB-B | 33,182 | 172.600 | 5,727,213.20 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 34,897 | 65.600 | 2,289,243.20 | |
| | INDUTRADE AB | 27,951 | 305.400 | 8,536,235.40 | |
| | INVESTMENT AB LATOUR-B SHS | 8,223 | 319.500 | 2,627,248.50 | |
| | LIFCO AB-B SHS | 24,912 | 331.000 | 8,245,872.00 | |
| | NIBE INDUSTRIER AB-B SHS | 109,274 | 46.710 | 5,104,188.54 | |
| | SAAB AB-B | 27,812 | 233.000 | 6,480,196.00 | |
| | SANDVIK AB | 87,237 | 206.300 | 17,996,993.10 | |
| | SKANSKA AB-B SHS | 26,915 | 205.900 | 5,541,798.50 | |
| | SKF AB-B SHARES | 31,715 | 186.700 | 5,921,190.50 | |
| | TRELLEBORG AB-B SHS | 21,827 | 389.400 | 8,499,433.80 | |
| | VOLVO AB-A SHS | 13,283 | 257.800 | 3,424,357.40 | |
| | VOLVO AB-B SHS | 137,659 | 254.300 | 35,006,683.70 | |
| | SECURITAS AB-B SHS | 41,010 | 120.950 | 4,960,159.50 | |
| | VOLVO CAR AB-B | 100,230 | 24.490 | 2,454,632.70 | |
| | EVOLUTION AB | 14,444 | 1,001.000 | 14,458,444.00 | |
| | HENNES & MAURITZ AB-B SHS | 52,210 | 170.600 | 8,907,026.00 | |
| | ESSITY AKTIEBOLAG-B | 50,329 | 324.300 | 16,321,694.70 | |
| | GETINGE AB-B SHS | 21,124 | 223.000 | 4,710,652.00 | |
| | SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB | 13,513 | 332.000 | 4,486,316.00 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 129,315 | 156.800 | 20,276,592.00 | |
| | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 126,700 | 104.300 | 13,214,810.00 | |
| | SWEDBANK AB - A SHARES | 72,723 | 217.000 | 15,780,891.00 | |
| | EQT AB | 29,893 | 353.900 | 10,579,132.70 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-A SHS | 10,598 | 358.400 | 3,798,323.20 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 14,289 | 356.000 | 5,086,884.00 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 146,684 | 303.750 | 44,555,265.00 | |
| | LUNDBERGS AB-B SHS | 6,081 | 564.500 | 3,432,724.50 | |
| | ERICSSON LM-B SHS | 253,908 | 75.300 | 19,119,272.40 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 175,674 | 99.200 | 17,426,860.80 | |
| | TELE2 AB-B SHS | 58,043 | 118.250 | 6,863,584.75 | |
| | TELIA CO AB | 187,675 | 33.190 | 6,228,933.25 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS | 60,454 | 85.920 | 5,194,207.68 | |
| | SAGAX AB-B | 14,721 | 269.400 | 3,965,837.40 | |
| スウェーデン・クローナ小計 | | 2,819,560 | | 487,909,094.22<br>(6,742,903,681) | |
| ユーロ | ENI SPA | 196,350 | 14.114 | 2,771,283.90 | |
| | GALP ENERGIA SGPS SA | 43,361 | 17.030 | 738,437.83 | |
| | NESTE OYJ | 31,509 | 16.265 | 512,493.88 | |
| | OMV AG | 9,988 | 36.340 | 362,963.92 | |
| | REPSOL SA | 96,457 | 11.735 | 1,131,922.89 | |
| | TENARIS SA | 41,201 | 12.820 | 528,196.82 | |
| | TOTALENERGIES SE | 186,444 | 61.220 | 11,414,101.68 | |
| | AIR LIQUIDE SA | 49,230 | 169.520 | 8,345,469.60 | |
| | AKZO NOBEL N.V. | 14,109 | 57.440 | 810,420.96 | |
| | ARCELORMITTAL | 36,865 | 20.510 | 756,101.15 | |
| | ARKEMA | 5,145 | 79.100 | 406,969.50 | |
| | BASF SE | 73,728 | 43.555 | 3,211,223.04 | |
| | COVESTRO AG | 16,049 | 55.620 | 892,645.38 | |
| | DSM-FIRMENICH AG | 15,761 | 120.400 | 1,897,624.40 | |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 17,669 | 20.040 | 354,086.76 | |
| | HEIDELBERG MATERIALS AG | 12,541 | 93.760 | 1,175,844.16 | |
| | OCI NV | 11,025 | 26.850 | 296,021.25 | |
| | STORA ENSO OYJ-R SHS | 47,758 | 11.005 | 525,576.79 | |
| | SYENSQO SA | 6,353 | 71.730 | 455,700.69 | |
| | SYMRISE AG | 11,030 | 120.600 | 1,330,218.00 | |
| | UPM-KYMMENE OYJ | 43,970 | 29.110 | 1,279,966.70 | |
| | VOESTALPINE AG | 12,233 | 20.680 | 252,978.44 | |
| | ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 19,741 | 41.000 | 809,381.00 | |
| | AIRBUS SE | 49,345 | 129.420 | 6,386,229.90 | |
| | ALSTOM | 25,574 | 17.250 | 441,151.50 | |
| | BOUYGUES SA | 17,123 | 32.040 | 548,620.92 | |
| | BRENNTAG SE | 12,153 | 63.660 | 773,659.98 | |
| | COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN | 36,112 | 78.660 | 2,840,569.92 | |
| | DAIMLER TRUCK HOLDING AG | 44,374 | 31.060 | 1,378,256.44 | |
| | DASSAULT AVIATION SA | 1,720 | 190.800 | 328,176.00 | |
| | EIFFAGE | 6,641 | 92.260 | 612,698.66 | |
| | FERROVIAL SE | 42,157 | 37.780 | 1,592,691.46 | |
| | GEA GROUP AG | 10,467 | 42.080 | 440,451.36 | |
| | IMCD NV | 4,340 | 156.000 | 677,040.00 | |
| | KINGSPAN GROUP PLC | 11,723 | 79.850 | 936,081.55 | |
| | KNORR-BREMSE AG | 7,217 | 74.350 | 536,583.95 | |
| | KONE OYJ-B | 27,371 | 49.820 | 1,363,623.22 | |
| | LEGRAND SA | 20,908 | 102.500 | 2,143,070.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| LEONARDO SPA | 35,486 | 20.780 | 737,399.08 | |
| METSO CORP | 50,483 | 8.448 | 426,480.38 | |
| MTU AERO ENGINES AG | 4,961 | 276.400 | 1,371,220.40 | |
| PRYSMIAN SPA | 24,541 | 61.520 | 1,509,762.32 | |
| RATIONAL AG | 350 | 879.000 | 307,650.00 | |
| REXEL SA | 23,491 | 25.050 | 588,449.55 | |
| RHEINMETALL AG | 3,447 | 518.200 | 1,786,235.40 | |
| SAFRAN SA | 29,905 | 203.300 | 6,079,686.50 | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 46,198 | 227.150 | 10,493,875.70 | |
| SIEMENS AG-REG | 64,408 | 162.900 | 10,492,063.20 | |
| SIEMENS ENERGY AG | 55,049 | 29.110 | 1,602,476.39 | |
| THALES SA | 8,928 | 147.650 | 1,318,219.20 | |
| VINCI SA | 41,998 | 109.600 | 4,602,980.80 | |
| WARTSILA OYJ ABP | 45,125 | 18.700 | 843,837.50 | |
| BUREAU VERITAS SA | 30,794 | 29.980 | 923,204.12 | |
| RANDSTAD NV | 8,946 | 42.600 | 381,099.60 | |
| TELEPERFORMANCE | 4,299 | 99.800 | 429,040.20 | |
| WOLTERS KLUWER | 20,806 | 157.650 | 3,280,065.90 | |
| ADP | 3,679 | 115.500 | 424,924.50 | |
| AENA SME SA | 5,921 | 191.800 | 1,135,647.80 | |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 50,885 | 5.886 | 299,509.11 | |
| DHL GROUP | 90,860 | 39.620 | 3,599,873.20 | |
| GETLINK SE | 30,428 | 16.175 | 492,172.90 | |
| INPOST SA | 24,153 | 17.080 | 412,533.24 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 27,028 | 72.520 | 1,960,070.56 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 6,498 | 68.850 | 447,387.30 | |
| CONTINENTAL AG | 8,078 | 53.280 | 430,395.84 | |
| DR ING HC F PORSCHE AG | 8,498 | 67.380 | 572,595.24 | |
| FERRARI NV | 10,626 | 416.800 | 4,428,916.80 | |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG | 66,276 | 56.540 | 3,747,245.04 | |
| MICHELIN (CGDE) | 59,151 | 36.230 | 2,143,040.73 | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF | 14,142 | 39.770 | 562,427.34 | |
| RENAULT SA | 14,764 | 38.770 | 572,400.28 | |
| STELLANTIS NV | 190,785 | 13.590 | 2,592,768.15 | |
| VOLKSWAGEN AG-PREF | 16,257 | 91.080 | 1,480,687.56 | |
| ADIDAS AG | 13,498 | 219.300 | 2,960,111.40 | |
| HERMES INTERNATIONAL | 2,670 | 1,896.000 | 5,062,320.00 | |
| KERING | 6,767 | 225.550 | 1,526,296.85 | |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 23,687 | 603.600 | 14,297,473.20 | |
| MONCLER SPA | 19,596 | 50.760 | 994,692.96 | |
| PUMA SE | 9,601 | 38.380 | 368,486.38 | |
| SEB SA | 1,127 | 93.000 | 104,811.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ACCOR SA | 16,469 | 38.350 | 631,586.15 | |
| AMADEUS IT GROUP SA | 40,884 | 63.720 | 2,605,128.48 | |
| DELIVERY HERO SE | 13,293 | 27.830 | 369,944.19 | |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | 5,785 | 38.160 | 220,755.60 | |
| SODEXO SA | 6,960 | 78.200 | 544,272.00 | |
| D'IETEREN GROUP | 1,244 | 197.800 | 246,063.20 | |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL | 93,013 | 50.380 | 4,685,994.94 | |
| PROSUS NV | 117,720 | 32.250 | 3,796,470.00 | |
| ZALANDO SE | 17,418 | 24.000 | 418,032.00 | |
| CARREFOUR SA | 49,914 | 15.345 | 765,930.33 | |
| JERONIMO MARTINS | 22,106 | 16.760 | 370,496.56 | |
| KESKO OYJ-B SHS | 20,250 | 18.115 | 366,828.75 | |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 78,401 | 30.990 | 2,429,646.99 | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 78,137 | 58.120 | 4,541,322.44 | |
| DANONE | 55,871 | 65.300 | 3,648,376.30 | |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | 48,521 | 7.602 | 368,856.64 | |
| HEINEKEN HOLDING NV | 10,567 | 68.400 | 722,782.80 | |
| HEINEKEN NV | 22,805 | 81.960 | 1,869,097.80 | |
| JDE PEET'S NV | 13,317 | 20.440 | 272,199.48 | |
| KERRY GROUP PLC-A | 14,401 | 92.950 | 1,338,572.95 | |
| LOTUS BAKERIES | 31 | 12,120.000 | 375,720.00 | |
| PERNOD RICARD SA | 17,848 | 126.300 | 2,254,202.40 | |
| BEIERSDORF AG | 8,764 | 126.950 | 1,112,589.80 | |
| HENKEL AG & CO KGAA | 8,714 | 72.900 | 635,250.60 | |
| HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF | 15,381 | 80.500 | 1,238,170.50 | |
| L'OREAL | 20,209 | 365.900 | 7,394,473.10 | |
| AMPLIFON SPA | 10,123 | 27.270 | 276,054.21 | |
| BIOMERIEUX | 2,791 | 108.500 | 302,823.50 | |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR | 3,583 | 57.000 | 204,231.00 | |
| DIASORIN SPA | 1,313 | 103.600 | 136,026.80 | |
| ESSILORLUXOTTICA | 25,357 | 208.100 | 5,276,791.70 | |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG | 17,125 | 37.260 | 638,077.50 | |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 31,227 | 34.040 | 1,062,967.08 | |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 71,360 | 27.700 | 1,976,672.00 | |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 23,498 | 49.410 | 1,161,036.18 | |
| ARGENX SE | 5,283 | 485.500 | 2,564,896.50 | |
| BAYER AG-REG | 82,511 | 26.710 | 2,203,868.81 | |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 14,665 | 52.400 | 768,446.00 | |
| GRIFOLS SA | 15,169 | 10.100 | 153,206.90 | |
| IPSEN | 3,380 | 109.700 | 370,786.00 | |
| MERCK KGAA | 11,293 | 166.050 | 1,875,202.65 | |
| ORION OYJ-CLASS B | 10,542 | 47.090 | 496,422.78 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| QIAGEN N.V. | 20,951 | 41.755 | 874,809.00 | |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA | 8,068 | 50.550 | 407,837.40 | |
| SANOFI | 96,131 | 103.320 | 9,932,254.92 | |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 2,164 | 240.000 | 519,360.00 | |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 2,207 | 182.400 | 402,556.80 | |
| UCB SA | 10,385 | 164.450 | 1,707,813.25 | |
| ABN AMRO BANK NV-CVA | 43,340 | 16.210 | 702,541.40 | |
| AIB GROUP PLC | 154,127 | 5.325 | 820,726.27 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 484,418 | 9.322 | 4,515,744.59 | |
| BANCO BPM SPA | 108,163 | 5.974 | 646,165.76 | |
| BANCO DE SABADELL SA | 515,705 | 1.891 | 975,198.15 | |
| BANCO SANTANDER SA | 1,319,421 | 4.440 | 5,858,229.24 | |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC | 87,661 | 9.790 | 858,201.19 | |
| BNP PARIBAS | 87,860 | 63.290 | 5,560,659.40 | |
| CAIXABANK SA | 308,048 | 5.430 | 1,672,700.64 | |
| COMMERZBANK AG | 82,105 | 15.595 | 1,280,427.47 | |
| CREDIT AGRICOLE SA | 90,899 | 14.260 | 1,296,219.74 | |
| ERSTE GROUP BANK AG | 30,160 | 47.740 | 1,439,838.40 | |
| FINECOBANK SPA | 60,333 | 15.080 | 909,821.64 | |
| ING GROEP NV | 280,658 | 16.298 | 4,574,164.08 | |
| INTESA SANPAOLO | 1,231,042 | 3.739 | 4,602,866.03 | |
| KBC GROUP NV | 20,304 | 68.940 | 1,399,757.76 | |
| MEDIOBANCA SPA | 47,708 | 14.950 | 713,234.60 | |
| NORDEA BANK ABP | 266,860 | 10.375 | 2,768,672.50 | |
| SOCIETE GENERALE SA | 68,477 | 22.275 | 1,525,325.17 | |
| UNICREDIT SPA | 125,812 | 37.100 | 4,667,625.20 | |
| ADYEN NV | 1,711 | 1,284.600 | 2,197,950.60 | |
| AMUNDI SA | 3,955 | 67.350 | 266,369.25 | |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED | 161,748 | 14.598 | 2,361,197.30 | |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 16,203 | 208.200 | 3,373,464.60 | |
| EDENRED | 20,297 | 35.570 | 721,964.29 | |
| EURAZEO SE | 3,897 | 72.200 | 281,363.40 | |
| EURONEXT NV | 7,818 | 100.600 | 786,490.80 | |
| EXOR NV | 8,669 | 97.650 | 846,527.85 | |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV | 7,933 | 68.800 | 545,790.40 | |
| NEXI SPA | 57,060 | 6.076 | 346,696.56 | |
| SOFINA | 1,314 | 252.400 | 331,653.60 | |
| AEGON LTD | 127,748 | 5.434 | 694,182.63 | |
| AGEAS | 11,247 | 47.360 | 532,657.92 | |
| ALLIANZ SE-REG | 32,898 | 287.500 | 9,458,175.00 | |
| ASR NEDERLAND NV | 14,593 | 43.460 | 634,211.78 | |
| AXA SA | 152,526 | 36.190 | 5,519,915.94 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GENERALI | 82,510 | 25.980 | 2,143,609.80 | |
| HANNOVER RUECK SE | 5,315 | 256.200 | 1,361,703.00 | |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 11,630 | 485.900 | 5,651,017.00 | |
| NN GROUP NV | 20,802 | 44.690 | 929,641.38 | |
| POSTE ITALIANE SPA | 34,720 | 12.675 | 440,076.00 | |
| SAMPO OYJ-A SHS | 41,813 | 41.980 | 1,755,309.74 | |
| TALANX AG | 5,345 | 76.550 | 409,159.75 | |
| BECHTLE AG | 8,953 | 36.900 | 330,365.70 | |
| CAPGEMINI SE | 12,750 | 190.150 | 2,424,412.50 | |
| DASSAULT SYSTEMES SE | 57,951 | 35.500 | 2,057,260.50 | |
| NEMETSCHEK SE | 5,941 | 88.050 | 523,105.05 | |
| SAP SE | 89,076 | 200.150 | 17,828,561.40 | |
| NOKIA OYJ | 442,364 | 3.797 | 1,679,656.10 | |
| ASM INTERNATIONAL NV | 4,006 | 567.600 | 2,273,805.60 | |
| ASML HOLDING NV | 34,249 | 719.900 | 24,655,855.10 | |
| BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES | 6,286 | 111.250 | 699,317.50 | |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 106,869 | 29.050 | 3,104,544.45 | |
| STMICROELECTRONICS NV | 54,733 | 24.890 | 1,362,304.37 | |
| CELLNEX TELECOM SA | 39,938 | 36.700 | 1,465,724.60 | |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 301,061 | 26.910 | 8,101,551.51 | |
| ELISA OYJ | 14,245 | 46.920 | 668,375.40 | |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 28,190 | 11.070 | 312,063.30 | |
| KONINKLIJKE KPN NV | 367,935 | 3.731 | 1,372,765.48 | |
| ORANGE | 153,827 | 10.905 | 1,677,483.43 | |
| TELECOM ITALIA SPA | 696,355 | 0.249 | 173,392.39 | |
| TELEFONICA SA | 375,409 | 4.307 | 1,616,886.56 | |
| ACCIONA SA | 1,810 | 129.900 | 235,119.00 | |
| E.ON SE | 196,435 | 13.655 | 2,682,319.92 | |
| EDP RENOVAVEIS SA | 27,294 | 15.760 | 430,153.44 | |
| EDP SA | 255,288 | 4.103 | 1,047,446.66 | |
| ELIA GROUP SA/NV | 3,348 | 105.800 | 354,218.40 | |
| ENDESA SA | 25,535 | 19.835 | 506,486.72 | |
| ENEL SPA | 694,419 | 7.132 | 4,952,596.30 | |
| ENGIE | 165,196 | 15.970 | 2,638,180.12 | |
| FORTUM OYJ | 42,339 | 14.030 | 594,016.17 | |
| IBERDROLA SA | 532,553 | 13.520 | 7,200,116.56 | |
| REDEIA CORP SA | 34,539 | 17.390 | 600,633.21 | |
| RWE AG | 53,937 | 32.670 | 1,762,121.79 | |
| SNAM SPA | 168,809 | 4.601 | 776,690.20 | |
| TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA | 109,980 | 8.144 | 895,677.12 | |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 57,958 | 30.120 | 1,745,694.96 | |
| VERBUND AG | 5,338 | 73.450 | 392,076.10 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | BOLLORE SE | 69,288 | 5.905 | 409,145.64 | |
| | CTS EVENTIM AG & CO KGAA | 6,099 | 85.750 | 522,989.25 | |
| | PUBLICIS GROUPE | 20,799 | 96.700 | 2,011,263.30 | |
| | SCOUT24 SE | 6,149 | 73.700 | 453,181.30 | |
| | UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | 66,170 | 23.390 | 1,547,716.30 | |
| | VIVENDI SE | 57,161 | 10.100 | 577,326.10 | |
| | LEG IMMOBILIEN SE | 7,909 | 93.560 | 739,966.04 | |
| | VONOVIA SE | 60,885 | 33.200 | 2,021,382.00 | |
| ユーロ小計 | | 15,501,310 | | 431,385,167.56<br>(67,533,347,982) | |
| 合　計 | | 92,725,720 | | 758,251,843,710<br>(758,251,843,710) | |

(注) 金額欄の(　)内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 通　貨 | 銘柄数 | | 組入株式時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 株式 | 572銘柄 | 73.4% | 76.2% |
| カナダ・ドル | 株式 | 84銘柄 | 3.2% | 3.3% |
| オーストラリア・ドル | 株式 | 48銘柄 | 1.8% | 1.9% |
| 香港・ドル | 株式 | 22銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| シンガポール・ドル | 株式 | 12銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| ニュージーランド・ドル | 株式 | 5銘柄 | 0.0% | 0.0% |
| イギリス・ポンド | 株式 | 76銘柄 | 3.9% | 4.0% |
| イスラエル・シュケル | 株式 | 8銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| スイス・フラン | 株式 | 46銘柄 | 2.6% | 2.7% |
| デンマーク・クローネ | 株式 | 16銘柄 | 1.0% | 1.0% |
| ノルウェー・クローネ | 株式 | 11銘柄 | 0.1% | 0.2% |
| スウェーデン・クローナ | 株式 | 44銘柄 | 0.9% | 0.9% |
| ユーロ | 株式 | 214銘柄 | 8.6% | 8.9% |

(b)株式以外の有価証券

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 新株予約権証券 | カナダ・ドル | CONSTELLATION SOFTWARE INC-CW40 | 1,480.00 | - | |
| | カナダ・ドル小計 | | 1,480.00 | -<br>(-) | |
| 新株予約権証券合計 | | | | -<br>(-) | |
| 投資証券 | アメリカ・ドル | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 13,343.00 | 1,664,005.53 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 26,290.00 | 1,076,575.50 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 39,217.00 | 9,424,629.44 | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 35,166.00 | 732,859.44 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 11,975.00 | 2,788,498.50 | |
| | | BXP INC | 13,802.00 | 1,124,863.00 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 7,861.00 | 982,074.73 | |
| | | CROWN CASTLE INC | 36,492.00 | 4,388,163.00 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 27,519.00 | 4,426,981.53 | |
| | | EQUINIX INC | 8,298.00 | 7,273,777.86 | |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 14,256.00 | 1,073,619.36 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 29,734.00 | 2,312,413.18 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 5,455.00 | 1,719,143.25 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 17,630.00 | 3,131,616.90 | |
| | | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 22,625.00 | 1,168,581.25 | |
| | | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 65,292.00 | 1,463,193.72 | |
| | | HOST HOTELS & RESORTS INC | 59,277.00 | 1,034,976.42 | |
| | | INVITATION HOMES INC | 55,309.00 | 2,033,711.93 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 23,774.00 | 2,809,849.06 | |
| | | KIMCO REALTY CORP | 57,934.00 | 1,393,892.04 | |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 9,567.00 | 1,594,340.55 | |
| | | PROLOGIS INC | 78,263.00 | 10,117,840.64 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 13,973.00 | 5,072,059.27 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 76,815.00 | 4,814,764.20 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 13,101.00 | 979,561.77 | |
| | | SBA COMMUNICATIONS CORP | 8,887.00 | 2,178,114.83 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 28,094.00 | 4,632,700.60 | |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 10,118.00 | 1,476,317.38 | |
| | | UDR INC | 27,406.00 | 1,287,259.82 | |
| | | VENTAS INC | 34,880.00 | 2,256,736.00 | |
| | | VICI PROPERTIES INC | 84,341.00 | 2,870,967.64 | |
| | | WELLTOWER INC | 52,362.00 | 6,764,123.16 | |
| | | WEYERHAEUSER CO | 65,282.00 | 2,122,317.82 | |
| | | WP CAREY INC | 16,778.00 | 1,073,120.88 | |
| | アメリカ・ドル小計 | | 1,091,116.00 | 99,263,650.20<br>(13,973,344,040) | |
| | カナダ・ドル | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 8,170.00 | 460,134.40 | |
| | カナダ・ドル小計 | | 8,170.00 | 460,134.40<br>(47,651,518) | |
| | オーストラリア・ドル | APA GROUP | 108,912.00 | 824,463.84 | |
| | | DEXUS/AU | 125,845.00 | 952,646.65 | |
| | | GOODMAN GROUP | 141,942.00 | 5,057,393.46 | |
| | | GPT GROUP | 159,776.00 | 810,064.32 | |
| | | MIRVAC GROUP | 326,863.00 | 735,441.75 | |
| | | SCENTRE GROUP | 452,086.00 | 1,672,718.20 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | STOCKLAND | 193,824.00 | 1,021,452.48 | |
| | | TRANSURBAN GROUP | 256,783.00 | 3,566,715.87 | |
| | | VICINITY CENTRES | 372,431.00 | 867,764.23 | |
| | | オーストラリア・ドル小計 | 2,138,462.00 | 15,508,660.80<br>(1,471,616,823) | |
| | 香港・ドル | HKT TRUST AND HKT LTD-SS | 437,000.00 | 4,422,440.00 | |
| | | LINK REIT | 238,500.00 | 9,110,700.00 | |
| | | 香港・ドル小計 | 675,500.00 | 13,533,140.00<br>(244,408,508) | |
| | シンガポール・ドル | CAPITALAND ASCENDAS REIT | 322,200.00 | 947,268.00 | |
| | | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 408,716.00 | 886,913.72 | |
| | | シンガポール・ドル小計 | 730,916.00 | 1,834,181.72<br>(199,173,793) | |
| | イギリス・ポンド | LAND SECURITIES GROUP PLC | 59,857.00 | 403,735.46 | |
| | | SEGRO PLC | 115,483.00 | 1,044,428.25 | |
| | | イギリス・ポンド小計 | 175,340.00 | 1,448,163.71<br>(269,126,744) | |
| | ユーロ | COVIVIO | 7,110.00 | 389,983.50 | |
| | | GECINA SA | 3,082.00 | 330,390.40 | |
| | | KLEPIERRE | 18,172.00 | 530,258.96 | |
| | | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 8,942.00 | 693,005.00 | |
| | | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 14,027.00 | 347,027.98 | |
| | | ユーロ小計 | 51,333.00 | 2,290,665.84<br>(358,603,737) | |
| 投資証券合計 | | | | 16,563,925,164<br>(16,563,925,164) | |
| 合　計 | | | | 16,563,925,164<br>(16,563,925,164) | |

(注) 金額欄の(　)内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 通　貨 | 銘柄数 | | 組入<br>新株予約権証券<br>時価比率 | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 投資証券 | 34銘柄 | - | 1.8% | 84.4% |
| カナダ・ドル | 新株予約権証券 | 1銘柄 | - | - | - |
| | 投資証券 | 1銘柄 | - | 0.0% | 0.3% |
| オーストラリア・ドル | 投資証券 | 9銘柄 | - | 0.2% | 8.9% |
| 香港・ドル | 投資証券 | 2銘柄 | - | 0.0% | 1.5% |
| シンガポール・ドル | 投資証券 | 2銘柄 | - | 0.0% | 1.2% |
| イギリス・ポンド | 投資証券 | 2銘柄 | - | 0.0% | 1.6% |
| ユーロ | 投資証券 | 5銘柄 | - | 0.0% | 2.2% |

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

| | （2024年9月17日現在） |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 2,384,665,288 |
| 金銭信託 | 1,461,846 |
| コール・ローン | 145,342,230 |
| 株式 | 39,236,619,466 |
| 投資信託受益証券 | 1,534,261,607 |
| 投資証券 | 3,276,149,883 |
| 派生商品評価勘定 | 32,943,135 |
| 未収入金 | 158,194 |
| 未収配当金 | 108,376,299 |
| 差入委託証拠金 | 663,023,388 |
| 流動資産合計 | 47,383,001,336 |
| 資産合計 | 47,383,001,336 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 23,123,012 |
| 未払解約金 | 12,816,610 |
| 流動負債合計 | 35,939,622 |
| 負債合計 | 35,939,622 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 23,828,437,374 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 23,518,624,340 |
| 元本等合計 | 47,347,061,714 |
| 純資産合計 | 47,347,061,714 |
| 負債純資産合計 | 47,383,001,336 |

（２）注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項　目 | 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 |

| | |
|---|---|
| | 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| 2．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | (1) 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。<br>(2) 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| 3．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。 |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | （2024年9月17日現在） |
|---|---|
| 1．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 23,828,437,374口 |
| 2．　1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額　1.9870円<br>（1万口当たりの純資産額19,870円） |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

| 項　目 | 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| 1．　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容<br>1) 有価証券<br>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。<br>2) デリバティブ取引 |

| | |
|---|---|
| | 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。<br>当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。<br>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>(2) 金融商品に係るリスク<br>有価証券およびデリバティブ取引等<br>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。<br>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。<br>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。 |

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | (2024年9月17日現在) |
|---|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 |

| | |
|---|---|
| | これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区　分 | 種　類 | 契　約　額　等 | うち1年超 | 時　価 | 評価損益 |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | MSCI EMGMKT SEP24 | 3,385,269,337 | － | 3,395,562,440 | 10,293,103 |
| | 小計 | 3,385,269,337 | － | 3,395,562,440 | 10,293,103 |
| 合　計 | | 3,385,269,337 | － | 3,395,562,440 | 10,293,103 |

(注) 1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

| 区　分 | 種　類 | 契　約　額　等 | うち1年超 | 時　価 | 評価損益 |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 188,100,521 | － | 187,636,545 | △463,976 |
| | 台湾・ドル | 56,253 | － | 56,159 | △94 |
| | 小計 | 188,156,774 | － | 187,692,704 | △464,070 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 56,253 | － | 55,939 | 314 |
| | 台湾・ドル | 2,600,521 | － | 2,609,745 | △9,224 |
| | 小計 | 2,656,774 | － | 2,665,684 | △8,910 |
| 合　計 | | 190,813,548 | － | 190,358,388 | △472,980 |

(注) 1．時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しており

ます。

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2)計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| (2024年9月17日現在) | |
|---|---|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 20,327,562,024円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 6,666,201,801円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 3,165,326,451円 |
| | |
| 2024年9月17日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド | 12,841,087,357円 |
| 三井住友・ＤＣ新興国株式インデックスファンド | 3,530,712,067円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 21,555,748円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 163,832,351円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 110,983,901円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０ | 72,974,063円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 126,064,083円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 96,717,179円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 480,854,552円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 333,559,569円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 520,021,139円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 154,489,712円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０ | 10,349,272円 |
| 日興ＦＷＳ・新興国株インデックス（為替ヘッジあり） | 443,566,893円 |

| | |
|---|---|
| 日興ＦＷＳ・新興国株インデックス（為替ヘッジなし） | 4,589,766,817 円 |
| 三井住友ＤＳ・新興国株式インデックス・ファンド | 102,059,565 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５ | 20,642,992 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０ | 13,696,789 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５ | 15,347,316 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５ | 8,677,104 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５ | 5,529,660 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 298,679 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 7,911,447 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 38,028,973 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 41,025,298 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 16,463,051 円 |
| ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 62,221,797 円 |
| 合　計 | 23,828,437,374 円 |

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

| 通　貨 | 銘　柄 | 株　数 | 評価額 | | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカ・ドル | INNER MONGOLIA YITAI COAL-B | 42,200 | 1.913 | 80,728.60 | |
| | CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR | 6,558 | 13.370 | 87,680.46 | |
| | SOUTHERN COPPER CORP | 3,538 | 99.470 | 351,924.86 | |
| | H WORLD GROUP LTD-ADR | 7,842 | 28.740 | 225,379.08 | |
| | TAL EDUCATION GROUP- ADR | 16,231 | 7.420 | 120,434.02 | |
| | YUM CHINA HOLDINGS INC | 15,709 | 34.530 | 542,431.77 | |
| | PDD HOLDINGS INC | 28,413 | 97.200 | 2,761,743.60 | |
| | VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR | 15,698 | 12.840 | 201,562.32 | |
| | LEGEND BIOTECH CORP-ADR | 3,231 | 51.290 | 165,717.99 | |
| | CREDICORP LTD | 2,745 | 174.230 | 478,261.35 | |
| | INTER & CO INC - CL A | 9,819 | 7.220 | 70,893.18 | |
| | NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A | 120,588 | 14.890 | 1,795,555.32 | |
| | PAGSEGURO DIGITAL LTD-CL A | 8,080 | 9.020 | 72,881.60 | |
| | QIFU TECHNOLOGY INC | 5,288 | 24.920 | 131,776.96 | |
| | STONECO LTD-A | 10,214 | 12.390 | 126,551.46 | |
| | XP INC - CLASS A | 15,095 | 19.460 | 293,748.70 | |
| | SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B | 28,195 | 1.328 | 37,442.96 | |
| | AUTOHOME INC-ADR | 2,773 | 27.210 | 75,453.33 | |
| | IQIYI INC-ADR | 21,954 | 1.970 | 43,249.38 | |
| | KANZHUN LTD - ADR | 10,834 | 12.250 | 132,716.50 | |
| | TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR | 29,713 | 9.480 | 281,679.24 | |
| | KE HOLDINGS INC-ADR | 25,734 | 13.360 | 343,806.24 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル小計 | | 430,452 | | 8,421,618.92<br>(1,185,511,294) | |
| 香港・ドル | CHINA COAL ENERGY CO-H | 72,000 | 8.300 | 597,600.00 | |
| | CHINA OILFIELD SERVICES-H | 74,000 | 6.260 | 463,240.00 | |
| | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 1,008,000 | 4.390 | 4,425,120.00 | |
| | CHINA SHENHUA ENERGY CO-H | 141,000 | 30.400 | 4,286,400.00 | |
| | COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H | 52,000 | 7.210 | 374,920.00 | |
| | PETROCHINA CO LTD-H | 854,000 | 5.640 | 4,816,560.00 | |
| | YANKUANG ENERGY GROUP CO-H | 145,600 | 8.900 | 1,295,840.00 | |
| | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 176,000 | 4.670 | 821,920.00 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H | 53,000 | 17.440 | 924,320.00 | |
| | CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 122,000 | 10.100 | 1,232,200.00 | |
| | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 216,000 | 2.090 | 451,440.00 | |
| | CMOC GROUP LTD-H | 150,000 | 5.670 | 850,500.00 | |
| | JIANGXI COPPER CO LTD-H | 51,000 | 12.400 | 632,400.00 | |
| | MMG LTD | 120,000 | 2.150 | 258,000.00 | |
| | SHANDONG GOLD MINING CO LT-H | 25,000 | 15.840 | 396,000.00 | |
| | ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H | 54,000 | 12.960 | 699,840.00 | |
| | ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 240,000 | 14.740 | 3,537,600.00 | |
| | AVICHINA INDUSTRY & TECH-H | 99,000 | 3.070 | 303,930.00 | |
| | BOC AVIATION LTD | 10,300 | 63.100 | 649,930.00 | |
| | CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 126,000 | 3.820 | 481,320.00 | |
| | CHINA RAILWAY GROUP LTD-H | 152,000 | 3.120 | 474,240.00 | |
| | CHINA STATE CONSTRUCTION INT | 92,000 | 10.400 | 956,800.00 | |
| | CITIC LTD | 233,000 | 7.370 | 1,717,210.00 | |
| | CRRC CORP LTD - H | 203,000 | 4.290 | 870,870.00 | |
| | FOSUN INTERNATIONAL LTD | 72,000 | 3.990 | 287,280.00 | |
| | HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS | 21,000 | 21.200 | 445,200.00 | |
| | SINOTRUK HONG KONG LTD | 30,000 | 19.640 | 589,200.00 | |
| | WEICHAI POWER CO LTD-H | 89,000 | 10.960 | 975,440.00 | |
| | ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H | 19,400 | 26.300 | 510,220.00 | |
| | CHINA MERCHANTS PORT HOLDING | 60,140 | 11.940 | 718,071.60 | |
| | COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H | 114,400 | 10.480 | 1,198,912.00 | |
| | JD LOGISTICS INC | 70,500 | 10.200 | 719,100.00 | |
| | JIANGSU EXPRESS CO LTD-H | 50,000 | 7.570 | 378,500.00 | |
| | ORIENT OVERSEAS INTL LTD | 6,000 | 96.100 | 576,600.00 | |
| | ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H | 78,000 | 4.600 | 358,800.00 | |
| | ZTO EXPRESS CAYMAN INC | 17,300 | 173.000 | 2,992,900.00 | |
| | BYD CO LTD-H | 42,000 | 240.000 | 10,080,000.00 | |
| | FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H | 23,600 | 48.450 | 1,143,420.00 | |
| | GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 252,000 | 9.020 | 2,273,040.00 | |
| | GREAT WALL MOTOR CO LTD-H | 85,000 | 11.080 | 941,800.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 81,200 | 2.230 | 181,076.00 | |
| LI AUTO INC-CLASS A | 50,600 | 74.250 | 3,757,050.00 | |
| NIO INC-CLASS A | 55,210 | 43.000 | 2,374,030.00 | |
| XPENG INC - CLASS A SHARES | 46,700 | 35.100 | 1,639,170.00 | |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD | 48,000 | 10.920 | 524,160.00 | |
| ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG | 19,900 | 22.450 | 446,755.00 | |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 53,400 | 69.400 | 3,705,960.00 | |
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD | 172,000 | 3.600 | 619,200.00 | |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H | 96,400 | 23.950 | 2,308,780.00 | |
| HISENSE HOME APPLIANCES GR-H | 14,000 | 20.150 | 282,100.00 | |
| LI NING CO LTD | 98,000 | 12.920 | 1,266,160.00 | |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 34,400 | 56.450 | 1,941,880.00 | |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI | 59,000 | 12.420 | 732,780.00 | |
| MEITUAN-CLASS B | 201,660 | 126.500 | 25,509,990.00 | |
| NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC | 63,100 | 47.100 | 2,972,010.00 | |
| TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT | 52,400 | 14.180 | 743,032.00 | |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H | 29,000 | 8.900 | 258,100.00 | |
| TRIP.COM GROUP LTD | 22,850 | 371.800 | 8,495,630.00 | |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 619,900 | 82.000 | 50,831,800.00 | |
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU | 68,200 | 6.000 | 409,200.00 | |
| JD.COM INC-CLASS A | 101,685 | 103.400 | 10,514,229.00 | |
| MINISO GROUP HOLDING LTD | 13,200 | 30.200 | 398,640.00 | |
| POP MART INTERNATIONAL GROUP | 21,000 | 49.150 | 1,032,150.00 | |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD | 49,000 | 2.340 | 114,660.00 | |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS | 33,000 | 9.010 | 297,330.00 | |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION T | 208,000 | 2.750 | 572,000.00 | |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC | 40,800 | 22.500 | 918,000.00 | |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B | 5,000 | 93.000 | 465,000.00 | |
| CHINA FEIHE LTD | 127,000 | 4.360 | 553,720.00 | |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 133,000 | 12.520 | 1,665,160.00 | |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDING | 68,000 | 22.100 | 1,502,800.00 | |
| NONGFU SPRING CO LTD-H | 78,600 | 24.350 | 1,913,910.00 | |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDING | 89,000 | 8.900 | 792,100.00 | |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO | 90,000 | 10.580 | 952,200.00 | |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H | 26,000 | 40.950 | 1,064,700.00 | |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 166,000 | 4.700 | 780,200.00 | |
| GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD | 14,200 | 35.700 | 506,940.00 | |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD | 25,500 | 21.850 | 557,175.00 | |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 78,400 | 4.430 | 347,312.00 | |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H | 24,700 | 10.220 | 252,434.00 | |
| SINOPHARM GROUP CO-H | 55,600 | 16.740 | 930,744.00 | |
| AKESO INC | 27,000 | 71.600 | 1,933,200.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| BEIGENE LTD | 28,500 | 120.000 | 3,420,000.00 | |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC | 54,500 | 4.820 | 262,690.00 | |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT | 324,800 | 4.650 | 1,510,320.00 | |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP | 50,000 | 11.880 | 594,000.00 | |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP | 48,000 | 19.600 | 940,800.00 | |
| INNOVENT BIOLOGICS INC | 48,500 | 44.200 | 2,143,700.00 | |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 387,000 | 3.270 | 1,265,490.00 | |
| WUXI APPTEC CO LTD-H | 13,711 | 37.700 | 516,904.70 | |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 150,500 | 11.460 | 1,724,730.00 | |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 1,160,000 | 3.520 | 4,083,200.00 | |
| BANK OF CHINA LTD-H | 3,266,000 | 3.400 | 11,104,400.00 | |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H | 377,000 | 5.290 | 1,994,330.00 | |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-H | 363,000 | 4.460 | 1,618,980.00 | |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 3,933,000 | 5.450 | 21,434,850.00 | |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 77,000 | 2.250 | 173,250.00 | |
| CHINA MERCHANTS BANK-H | 158,500 | 29.450 | 4,667,825.00 | |
| CHINA MINSHENG BANKING COR-H | 265,100 | 2.730 | 723,723.00 | |
| IND & COMM BK OF CHINA-H | 2,850,000 | 4.260 | 12,141,000.00 | |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 326,000 | 4.130 | 1,346,380.00 | |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H | 132,000 | 4.180 | 551,760.00 | |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H | 58,400 | 8.080 | 471,872.00 | |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H | 64,500 | 11.620 | 749,490.00 | |
| FAR EAST HORIZON LTD | 84,000 | 5.430 | 456,120.00 | |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H | 80,800 | 3.660 | 295,728.00 | |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H | 43,200 | 8.160 | 352,512.00 | |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 292,000 | 11.420 | 3,334,640.00 | |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 110,400 | 19.640 | 2,168,256.00 | |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD | 61,000 | 9.450 | 576,450.00 | |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 30,100 | 15.800 | 475,580.00 | |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 397,000 | 3.040 | 1,206,880.00 | |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H | 286,000 | 10.120 | 2,894,320.00 | |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 269,500 | 35.100 | 9,459,450.00 | |
| KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR | 104,000 | 5.420 | 563,680.00 | |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 33,000 | 28.500 | 940,500.00 | |
| BYD ELECTRONIC INTL CO LTD | 29,000 | 25.550 | 740,950.00 | |
| LENOVO GROUP LTD | 316,000 | 9.400 | 2,970,400.00 | |
| SUNNY OPTICAL TECH | 31,500 | 43.500 | 1,370,250.00 | |
| XIAOMI CORP-CLASS B | 631,600 | 19.240 | 12,151,984.00 | |
| ZTE CORP-H | 23,800 | 15.120 | 359,856.00 | |
| GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD | 846,000 | 1.020 | 862,920.00 | |
| HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD | 19,000 | 15.340 | 291,460.00 | |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | 194,000 | 2.790 | 541,260.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | CHINA TOWER CORP LTD-H | 1,886,000 | 0.960 | 1,810,560.00 | |
| | BEIJING ENTERPRISES HLDGS | 17,000 | 23.550 | 400,350.00 | |
| | BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 206,000 | 2.150 | 442,900.00 | |
| | CGN POWER CO LTD-H | 446,000 | 2.800 | 1,248,800.00 | |
| | CHINA GAS HOLDINGS LTD | 94,400 | 6.040 | 570,176.00 | |
| | CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 141,000 | 5.390 | 759,990.00 | |
| | CHINA POWER INTERNATIONAL | 211,000 | 3.350 | 706,850.00 | |
| | CHINA RESOURCES GAS GROUP LT | 39,400 | 27.850 | 1,097,290.00 | |
| | CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 78,000 | 18.640 | 1,453,920.00 | |
| | ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 32,300 | 45.800 | 1,479,340.00 | |
| | GUANGDONG INVESTMENT LTD | 92,000 | 4.530 | 416,760.00 | |
| | HUANENG POWER INTL INC-H | 152,000 | 4.170 | 633,840.00 | |
| | KUNLUN ENERGY CO LTD | 162,000 | 7.290 | 1,180,980.00 | |
| | BAIDU INC-CLASS A | 91,900 | 82.600 | 7,590,940.00 | |
| | BILIBILI INC-CLASS Z | 10,220 | 114.900 | 1,174,278.00 | |
| | CHINA LITERATURE LTD | 12,200 | 25.400 | 309,880.00 | |
| | CHINA RUYI HOLDINGS LTD | 304,000 | 2.010 | 611,040.00 | |
| | KINGSOFT CORP LTD | 33,600 | 21.500 | 722,400.00 | |
| | KUAISHOU TECHNOLOGY | 98,500 | 39.900 | 3,930,150.00 | |
| | NETEASE INC | 77,700 | 120.200 | 9,339,540.00 | |
| | TENCENT HOLDINGS LTD | 266,600 | 377.800 | 100,721,480.00 | |
| | C&D INTERNATIONAL INVESTMENT | 21,000 | 10.280 | 215,880.00 | |
| | CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 152,500 | 10.700 | 1,631,750.00 | |
| | CHINA RESOURCES LAND LTD | 126,000 | 19.180 | 2,416,680.00 | |
| | CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY | 23,400 | 23.750 | 555,750.00 | |
| | CHINA VANKE CO LTD-H | 78,900 | 3.840 | 302,976.00 | |
| | LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 80,500 | 7.830 | 630,315.00 | |
| 香港・ドル小計 | | 31,811,876 | | 450,577,856.30<br>(8,137,436,085) | |
| 台湾・ドル | ASIA CEMENT CORP | 103,000 | 45.000 | 4,635,000.00 | |
| | CHINA STEEL CORP | 489,000 | 21.400 | 10,464,600.00 | |
| | FORMOSA CHEMICALS & FIBRE | 128,000 | 40.650 | 5,203,200.00 | |
| | FORMOSA PLASTICS CORP | 159,000 | 48.250 | 7,671,750.00 | |
| | NAN YA PLASTICS CORP | 198,000 | 42.150 | 8,345,700.00 | |
| | TCC GROUP HOLDINGS CO LTD | 270,676 | 32.200 | 8,715,767.20 | |
| | AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | 5,000 | 774.000 | 3,870,000.00 | |
| | FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 105,000 | 36.950 | 3,879,750.00 | |
| | FORTUNE ELECTRIC CO LTD | 5,500 | 577.000 | 3,173,500.00 | |
| | VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY | 3,000 | 2,020.000 | 6,060,000.00 | |
| | WALSIN LIHWA CORP | 108,000 | 31.600 | 3,412,800.00 | |
| | CHINA AIRLINES LTD | 106,000 | 20.650 | 2,188,900.00 | |
| | EVA AIRWAYS CORP | 120,000 | 35.900 | 4,308,000.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | EVERGREEN MARINE CORP LTD | 39,096 | 184.500 | 7,213,212.00 | |
| | TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP | 64,000 | 29.700 | 1,900,800.00 | |
| | WAN HAI LINES LTD | 25,605 | 78.300 | 2,004,871.50 | |
| | YANG MING MARINE TRANSPORT | 75,000 | 61.700 | 4,627,500.00 | |
| | CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 63,000 | 48.750 | 3,071,250.00 | |
| | ECLAT TEXTILE COMPANY LTD | 9,000 | 535.000 | 4,815,000.00 | |
| | FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 21,276 | 140.500 | 2,989,278.00 | |
| | NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 6,000 | 480.000 | 2,880,000.00 | |
| | POU CHEN | 104,000 | 34.600 | 3,598,400.00 | |
| | HOTAI MOTOR COMPANY LTD | 12,200 | 642.000 | 7,832,400.00 | |
| | PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 21,000 | 292.000 | 6,132,000.00 | |
| | UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 202,000 | 86.500 | 17,473,000.00 | |
| | PHARMAESSENTIA CORP | 9,000 | 698.000 | 6,282,000.00 | |
| | CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 278,418 | 17.750 | 4,941,919.50 | |
| | CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT | 654,000 | 32.700 | 21,385,800.00 | |
| | E.SUN FINANCIAL HOLDING CO | 561,385 | 27.700 | 15,550,364.50 | |
| | FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 474,876 | 27.350 | 12,987,858.60 | |
| | HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 358,519 | 25.500 | 9,142,234.50 | |
| | MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 484,702 | 39.350 | 19,073,023.70 | |
| | SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS | 430,039 | 23.450 | 10,084,414.55 | |
| | TAISHIN FINANCIAL HOLDING | 491,828 | 18.850 | 9,270,957.80 | |
| | TAIWAN BUSINESS BANK | 237,530 | 15.650 | 3,717,344.50 | |
| | TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 453,197 | 25.700 | 11,647,162.90 | |
| | THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | 143,299 | 38.350 | 5,495,516.65 | |
| | CHAILEASE HOLDING CO LTD | 58,988 | 142.000 | 8,376,296.00 | |
| | YUANTA FINANCIAL HOLDING CO | 427,393 | 30.500 | 13,035,486.50 | |
| | CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 388,000 | 63.100 | 24,482,800.00 | |
| | FUBON FINANCIAL HOLDING CO | 332,741 | 86.800 | 28,881,918.80 | |
| | KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD | 639,196 | 16.000 | 10,227,136.00 | |
| | SHIN KONG FINANCIAL HOLDING | 616,432 | 13.350 | 8,229,367.20 | |
| | ACCTON TECHNOLOGY CORP | 20,000 | 550.000 | 11,000,000.00 | |
| | ACER INC | 111,000 | 41.700 | 4,628,700.00 | |
| | ADVANTECH CO LTD | 18,727 | 325.500 | 6,095,638.50 | |
| | ASIA VITAL COMPONENTS | 13,000 | 544.000 | 7,072,000.00 | |
| | ASUSTEK COMPUTER INC | 28,000 | 544.000 | 15,232,000.00 | |
| | AUO CORP | 296,600 | 17.050 | 5,057,030.00 | |
| | CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 26,000 | 236.000 | 6,136,000.00 | |
| | COMPAL ELECTRONICS | 157,000 | 34.150 | 5,361,550.00 | |
| | DELTA ELECTRONICS INC | 79,000 | 385.500 | 30,454,500.00 | |
| | E INK HOLDINGS INC | 37,000 | 294.000 | 10,878,000.00 | |
| | GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD | 22,000 | 251.500 | 5,533,000.00 | |
| | HON HAI PRECISION INDUSTRY | 509,800 | 181.000 | 92,273,800.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | INNOLUX CORP | 331,903 | 15.500 | 5,144,496.50 | |
| | INVENTEC CORP | 110,000 | 43.550 | 4,790,500.00 | |
| | LARGAN PRECISION CO LTD | 4,480 | 2,625.000 | 11,760,000.00 | |
| | LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 84,000 | 101.500 | 8,526,000.00 | |
| | MICRO-STAR INTERNATIONAL CO | 27,000 | 170.500 | 4,603,500.00 | |
| | PEGATRON CORP | 81,000 | 101.500 | 8,221,500.00 | |
| | QUANTA COMPUTER INC | 108,000 | 254.000 | 27,432,000.00 | |
| | SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP | 53,000 | 69.900 | 3,704,700.00 | |
| | UNIMICRON TECHNOLOGY CORP | 56,000 | 146.500 | 8,204,000.00 | |
| | WISTRON CORP | 114,000 | 103.000 | 11,742,000.00 | |
| | WIWYNN CORP | 4,000 | 1,820.000 | 7,280,000.00 | |
| | WPG HOLDINGS LTD | 62,520 | 74.300 | 4,645,236.00 | |
| | YAGEO CORPORATION | 17,427 | 615.000 | 10,717,605.00 | |
| | ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 30,000 | 119.000 | 3,570,000.00 | |
| | ALCHIP TECHNOLOGIES LTD | 3,000 | 2,400.000 | 7,200,000.00 | |
| | ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT | 131,000 | 154.000 | 20,174,000.00 | |
| | EMEMORY TECHNOLOGY INC | 3,000 | 2,340.000 | 7,020,000.00 | |
| | GLOBAL UNICHIP CORP | 4,000 | 1,045.000 | 4,180,000.00 | |
| | GLOBALWAFERS CO LTD | 11,000 | 461.000 | 5,071,000.00 | |
| | MEDIATEK INC | 62,000 | 1,130.000 | 70,060,000.00 | |
| | NANYA TECHNOLOGY CORP | 48,000 | 46.600 | 2,236,800.00 | |
| | NOVATEK MICROELECTRONICS COR | 23,000 | 532.000 | 12,236,000.00 | |
| | REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 20,000 | 468.000 | 9,360,000.00 | |
| | SILERGY CORP | 13,800 | 394.000 | 5,437,200.00 | |
| | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 1,002,000 | 947.000 | 948,894,000.00 | |
| | UNITED MICROELECTRONICS CORP | 448,000 | 54.500 | 24,416,000.00 | |
| | VANGUARD INTERNATIONAL SEMI | 40,000 | 106.500 | 4,260,000.00 | |
| | WINBOND ELECTRONICS CORP | 118,000 | 21.050 | 2,483,900.00 | |
| | CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 159,000 | 125.000 | 19,875,000.00 | |
| | FAR EASTONE TELECOMM CO LTD | 72,000 | 91.900 | 6,616,800.00 | |
| | TAIWAN MOBILE CO LTD | 73,000 | 116.000 | 8,468,000.00 | |
| | RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 73,443 | 47.200 | 3,466,509.60 | |
| 台湾・ドル小計 | | 14,187,596 | | 1,840,797,246.00<br>(8,124,726,805) | |
| エジプト・ポンド | EASTERN CO SAE | 48,781 | 25.700 | 1,253,671.70 | |
| | COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN | 96,608 | 85.460 | 8,256,119.68 | |
| | T M G HOLDING | 30,309 | 57.000 | 1,727,613.00 | |
| エジプト・ポンド小計 | | 175,698 | | 11,237,404.38<br>(32,650,277) | |
| トルコ・リラ | TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 38,176 | 163.400 | 6,237,958.40 | |
| | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 48,657 | 47.620 | 2,317,046.34 | |
| | SASA POLYESTER SANAYI | 371,264 | 4.250 | 1,577,872.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 50,276 | 57.350 | 2,883,328.60 | |
| | KOC HOLDING AS | 31,180 | 172.000 | 5,362,960.00 | |
| | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI | 47,908 | 40.820 | 1,955,604.56 | |
| | PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS | 9,051 | 239.000 | 2,163,189.00 | |
| | TURK HAVA YOLLARI AO | 22,378 | 286.250 | 6,405,702.50 | |
| | FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 2,571 | 894.500 | 2,299,759.50 | |
| | TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA | 4,752 | 217.000 | 1,031,184.00 | |
| | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 18,318 | 568.000 | 10,404,624.00 | |
| | ANADOLU EFES BIRACILIK VE | 10,793 | 206.300 | 2,226,595.90 | |
| | COCA-COLA ICECEK AS | 39,039 | 62.750 | 2,449,697.25 | |
| | AKBANK T.A.S. | 126,956 | 56.200 | 7,134,927.20 | |
| | HACI OMER SABANCI HOLDING | 46,491 | 91.000 | 4,230,681.00 | |
| | TURKIYE IS BANKASI-C | 396,383 | 12.700 | 5,034,064.10 | |
| | YAPI VE KREDI BANKASI | 148,083 | 28.440 | 4,211,480.52 | |
| | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 48,118 | 91.200 | 4,388,361.60 | |
| トルコ・リラ小計 | | 1,460,394 | | 72,315,036.47<br>(299,304,703) | |
| メキシコ・ペソ | GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B | 126,200 | 103.420 | 13,051,604.00 | |
| | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 6,795 | 249.190 | 1,693,246.05 | |
| | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | 40,100 | 19.690 | 789,569.00 | |
| | ALFA S.A.B.-A | 126,300 | 13.300 | 1,679,790.00 | |
| | GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1 | 24,300 | 116.050 | 2,820,015.00 | |
| | GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B | 15,935 | 335.450 | 5,345,395.75 | |
| | GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B | 7,585 | 542.420 | 4,114,255.70 | |
| | GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT | 11,400 | 172.100 | 1,961,940.00 | |
| | PROMOTORA Y OPERADORA DE INF | 7,195 | 179.180 | 1,289,200.10 | |
| | GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA | 13,700 | 147.670 | 2,023,079.00 | |
| | WALMART DE MEXICO SAB DE CV | 210,300 | 60.640 | 12,752,592.00 | |
| | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | 20,700 | 179.510 | 3,715,857.00 | |
| | GRUMA S.A.B.-B | 6,425 | 366.460 | 2,354,505.50 | |
| | GRUPO BIMBO SAB- SERIES A | 56,400 | 68.940 | 3,888,216.00 | |
| | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A | 63,600 | 31.840 | 2,025,024.00 | |
| | BANCO DEL BAJIO SA | 26,900 | 46.370 | 1,247,353.00 | |
| | GRUPO FINANCIERO BANORTE-O | 103,200 | 142.080 | 14,662,656.00 | |
| | GRUPO FINANCIERO INBURSA-O | 67,700 | 45.060 | 3,050,562.00 | |
| | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B | 770,000 | 16.250 | 12,512,500.00 | |
| | OPERADORA DE SITES MEX- A-1 | 47,400 | 16.050 | 760,770.00 | |
| メキシコ・ペソ小計 | | 1,752,135 | | 91,738,130.10<br>(671,367,158) | |
| フィリピン・ペソ | AYALA CORPORATION | 11,640 | 634.000 | 7,379,760.00 | |
| | JG SUMMIT HOLDINGS INC | 116,262 | 25.900 | 3,011,185.80 | |
| | SM INVESTMENTS CORP | 9,035 | 948.500 | 8,569,697.50 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | INTL CONTAINER TERM SVCS INC | 41,320 | 413.400 | 17,081,688.00 | |
| | JOLLIBEE FOODS CORP | 19,650 | 255.000 | 5,010,750.00 | |
| | UNIVERSAL ROBINA CORP | 27,990 | 92.800 | 2,597,472.00 | |
| | BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN | 75,036 | 125.800 | 9,439,528.80 | |
| | BDO UNIBANK INC | 92,674 | 159.900 | 14,818,572.60 | |
| | METROPOLITAN BANK & TRUST | 84,590 | 73.150 | 6,187,758.50 | |
| | PLDT INC | 2,690 | 1,460.000 | 3,927,400.00 | |
| | MANILA ELECTRIC COMPANY | 10,060 | 420.000 | 4,225,200.00 | |
| | AYALA LAND INC | 275,600 | 34.700 | 9,563,320.00 | |
| | SM PRIME HOLDINGS INC | 404,100 | 31.800 | 12,850,380.00 | |
| フィリピン・ペソ小計 | | 1,170,647 | | 104,662,713.20<br>(263,666,307) | |
| チリ・ペソ | EMPRESAS CMPC SA | 48,976 | 1,521.000 | 74,492,496.00 | |
| | SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B | 5,698 | 35,052.000 | 199,726,296.00 | |
| | LATAM AIRLINES GROUP SA | 6,352,877 | 12.200 | 77,505,099.40 | |
| | EMPRESAS COPEC SA | 17,285 | 5,900.000 | 101,981,500.00 | |
| | FALABELLA SA | 34,870 | 3,011.000 | 104,993,570.00 | |
| | CENCOSUD SA | 53,544 | 1,775.000 | 95,040,600.00 | |
| | BANCO DE CHILE | 1,848,499 | 114.700 | 212,022,835.30 | |
| | BANCO DE CREDITO E INVERSION | 3,107 | 28,100.000 | 87,306,700.00 | |
| | BANCO SANTANDER CHILE | 2,903,646 | 47.830 | 138,881,388.18 | |
| | ENEL AMERICAS SA | 843,379 | 93.000 | 78,434,247.00 | |
| | ENEL CHILE SA | 971,320 | 48.730 | 47,332,423.60 | |
| チリ・ペソ小計 | | 13,083,201 | | 1,217,717,155.48<br>(185,586,183) | |
| コロンビア・ペソ | BANCOLOMBIA SA | 9,095 | 35,700.000 | 324,691,500.00 | |
| | BANCOLOMBIA SA-PREF | 18,853 | 33,700.000 | 635,346,100.00 | |
| | INTERCONEXION ELECTRICA SA | 19,631 | 16,800.000 | 329,800,800.00 | |
| コロンビア・ペソ小計 | | 47,579 | | 1,289,838,400.00<br>(42,805,867) | |
| インド・ルピー | BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 57,472 | 340.650 | 19,577,836.80 | |
| | COAL INDIA LTD | 75,181 | 493.250 | 37,083,028.25 | |
| | HINDUSTAN PETROLEUM CORP | 42,181 | 410.200 | 17,302,646.20 | |
| | INDIAN OIL CORP LTD | 106,892 | 171.820 | 18,366,183.44 | |
| | OIL & NATURAL GAS CORP LTD | 125,071 | 292.500 | 36,583,267.50 | |
| | OIL INDIA LTD | 19,843 | 607.600 | 12,056,606.80 | |
| | PETRONET LNG LTD | 27,436 | 336.100 | 9,221,239.60 | |
| | RELIANCE INDUSTRIES LTD | 124,068 | 2,942.700 | 365,094,903.60 | |
| | AMBUJA CEMENTS LTD | 24,411 | 627.300 | 15,313,020.30 | |
| | APL APOLLO TUBES LTD | 6,265 | 1,452.950 | 9,102,731.75 | |
| | ASIAN PAINTS LTD | 15,258 | 3,335.800 | 50,897,636.40 | |
| | GRASIM INDUSTRIES LTD | 10,470 | 2,765.300 | 28,952,691.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | HINDALCO INDUSTRIES LTD | 53,203 | 685.150 | 36,452,035.45 | |
| | JINDAL STAINLESS LTD | 14,795 | 759.450 | 11,236,062.75 | |
| | JINDAL STEEL & POWER LTD | 14,959 | 1,043.100 | 15,603,732.90 | |
| | JSW STEEL LTD | 26,244 | 971.000 | 25,482,924.00 | |
| | NMDC LTD | 43,717 | 219.100 | 9,578,394.70 | |
| | PI INDUSTRIES LTD | 3,459 | 4,656.500 | 16,106,833.50 | |
| | PIDILITE INDUSTRIES LTD | 5,741 | 3,304.750 | 18,972,569.75 | |
| | SHREE CEMENT LTD | 324 | 25,619.400 | 8,300,685.60 | |
| | SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD | 1,212 | 10,767.300 | 13,049,967.60 | |
| | SRF LTD | 5,894 | 2,436.900 | 14,363,088.60 | |
| | SUPREME INDUSTRIES LTD | 2,423 | 5,394.000 | 13,069,662.00 | |
| | TATA STEEL LTD | 297,861 | 154.210 | 45,933,144.81 | |
| | ULTRATECH CEMENT LTD | 4,814 | 11,642.650 | 56,047,717.10 | |
| | UPL LTD | 15,397 | 613.800 | 9,450,678.60 | |
| | VEDANTA LTD | 58,464 | 446.300 | 26,092,483.20 | |
| | ABB INDIA LTD | 2,065 | 7,765.200 | 16,035,138.00 | |
| | ADANI ENTERPRISES LTD | 6,462 | 2,984.900 | 19,288,423.80 | |
| | ASHOK LEYLAND LTD | 56,114 | 243.800 | 13,680,593.20 | |
| | ASTRAL LTD | 4,691 | 1,904.150 | 8,932,367.65 | |
| | BHARAT ELECTRONICS LTD | 149,477 | 290.400 | 43,408,120.80 | |
| | BHARAT HEAVY ELECTRICALS | 39,537 | 269.500 | 10,655,221.50 | |
| | CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU | 23,122 | 714.200 | 16,513,732.40 | |
| | CUMMINS INDIA LTD | 5,373 | 3,817.700 | 20,512,502.10 | |
| | HAVELLS INDIA LTD | 9,425 | 1,989.900 | 18,754,807.50 | |
| | HINDUSTAN AERONAUTICS LTD | 8,223 | 4,597.350 | 37,804,009.05 | |
| | LARSEN & TOUBRO LTD | 27,749 | 3,662.250 | 101,623,775.25 | |
| | POLYCAB INDIA LTD | 2,271 | 6,724.450 | 15,271,225.95 | |
| | RAIL VIKAS NIGAM LTD | 23,469 | 545.300 | 12,797,645.70 | |
| | SIEMENS LTD | 3,370 | 6,712.800 | 22,622,136.00 | |
| | SUZLON ENERGY LTD | 405,457 | 84.700 | 34,342,207.90 | |
| | THERMAX LTD | 1,883 | 5,003.900 | 9,422,343.70 | |
| | INDIAN RAILWAY CATERING & TO | 9,083 | 935.750 | 8,499,417.25 | |
| | ADANI PORTS AND SPECIAL ECON | 21,871 | 1,440.700 | 31,509,549.70 | |
| | CONTAINER CORP OF INDIA LTD | 10,064 | 951.500 | 9,575,896.00 | |
| | GMR AIRPORTS INFRASTRUCTURE | 104,248 | 97.130 | 10,125,608.24 | |
| | INTERGLOBE AVIATION LTD | 7,201 | 4,947.100 | 35,624,067.10 | |
| | BAJAJ AUTO LTD | 2,566 | 11,688.350 | 29,992,306.10 | |
| | BALKRISHNA INDUSTRIES LTD | 3,466 | 3,069.750 | 10,639,753.50 | |
| | BHARAT FORGE LTD | 10,961 | 1,601.200 | 17,550,753.20 | |
| | BOSCH LTD | 318 | 34,037.000 | 10,823,766.00 | |
| | EICHER MOTORS LTD | 5,571 | 4,899.200 | 27,293,443.20 | |
| | HERO MOTOCORP LTD | 5,124 | 5,779.450 | 29,613,901.80 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 37,574 | 2,757.400 | 103,606,547.60 | |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 5,221 | 12,289.000 | 64,160,869.00 | |
| MRF LTD | 88 | 136,427.000 | 12,005,576.00 | |
| SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN | 116,035 | 193.790 | 22,486,422.65 | |
| SONA BLW PRECISION FORGINGS | 15,537 | 733.650 | 11,398,720.05 | |
| TATA MOTORS LTD | 82,248 | 988.400 | 81,293,923.20 | |
| TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT | 4,025 | 4,047.100 | 16,289,577.50 | |
| TVS MOTOR CO LTD | 10,138 | 2,841.750 | 28,809,661.50 | |
| DIXON TECHNOLOGIES INDIA LTD | 1,437 | 13,990.300 | 20,104,061.10 | |
| PAGE INDUSTRIES LTD | 277 | 43,055.600 | 11,926,401.20 | |
| TITAN CO LTD | 14,492 | 3,740.650 | 54,209,499.80 | |
| INDIAN HOTELS CO LTD | 32,256 | 690.950 | 22,287,283.20 | |
| JUBILANT FOODWORKS LTD | 14,355 | 664.250 | 9,535,308.75 | |
| ZOMATO LTD | 263,052 | 277.700 | 73,049,540.40 | |
| TRENT LTD | 7,472 | 7,318.800 | 54,686,073.60 | |
| AVENUE SUPERMARTS LTD | 6,442 | 5,204.800 | 33,529,321.60 | |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD | 4,328 | 6,063.000 | 26,240,664.00 | |
| ITC LTD | 122,008 | 511.100 | 62,358,288.80 | |
| MARICO LTD | 23,047 | 695.200 | 16,022,274.40 | |
| NESTLE INDIA LTD | 13,199 | 2,549.600 | 33,652,170.40 | |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD | 24,849 | 1,218.500 | 30,278,506.50 | |
| UNITED SPIRITS LTD | 12,742 | 1,547.250 | 19,715,059.50 | |
| VARUN BEVERAGES LTD | 48,407 | 621.050 | 30,063,167.35 | |
| COLGATE PALMOLIVE (INDIA) | 5,865 | 3,664.150 | 21,490,239.75 | |
| DABUR INDIA LTD | 21,140 | 661.350 | 13,980,939.00 | |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 16,369 | 1,456.350 | 23,838,993.15 | |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD | 33,218 | 2,867.100 | 95,239,327.80 | |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE | 3,981 | 7,031.350 | 27,991,804.35 | |
| MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD | 32,458 | 931.000 | 30,218,398.00 | |
| AUROBINDO PHARMA LTD | 11,043 | 1,564.000 | 17,271,252.00 | |
| CIPLA LTD | 21,693 | 1,659.400 | 35,997,364.20 | |
| DIVI'S LABORATORIES LTD | 4,834 | 5,479.350 | 26,487,177.90 | |
| DR. REDDY'S LABORATORIES | 4,591 | 6,647.100 | 30,516,836.10 | |
| LUPIN LTD | 9,298 | 2,251.850 | 20,937,701.30 | |
| MANKIND PHARMA LTD | 4,543 | 2,456.250 | 11,158,743.75 | |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS | 38,994 | 1,862.950 | 72,643,872.30 | |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD | 3,991 | 3,453.900 | 13,784,514.90 | |
| ZYDUS LIFESCIENCES LTD | 10,229 | 1,115.850 | 11,414,029.65 | |
| AU SMALL FINANCE BANK LTD | 16,362 | 718.950 | 11,763,459.90 | |
| AXIS BANK LTD | 91,881 | 1,231.050 | 113,110,105.05 | |
| BANK OF BARODA | 38,009 | 239.150 | 9,089,852.35 | |
| CANARA BANK | 82,629 | 106.690 | 8,815,688.01 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HDFC BANK LIMITED | 174,052 | 1,670.950 | 290,832,189.40 | |
| ICICI BANK LTD | 212,839 | 1,262.850 | 268,783,731.15 | |
| IDFC FIRST BANK LTD | 131,058 | 73.740 | 9,664,216.92 | |
| INDUSIND BANK LTD | 10,740 | 1,470.200 | 15,789,948.00 | |
| KOTAK MAHINDRA BANK LTD | 44,196 | 1,831.300 | 80,936,134.80 | |
| PUNJAB NATIONAL BANK | 83,349 | 110.810 | 9,235,902.69 | |
| STATE BANK OF INDIA | 72,455 | 785.550 | 56,917,025.25 | |
| UNION BANK OF INDIA | 56,109 | 123.210 | 6,913,189.89 | |
| YES BANK LTD | 625,769 | 23.500 | 14,705,571.50 | |
| BAJAJ FINANCE LTD | 11,259 | 7,345.750 | 82,705,799.25 | |
| BAJAJ FINSERV LTD | 16,333 | 1,857.600 | 30,340,180.80 | |
| BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN | 1,217 | 10,400.000 | 12,656,800.00 | |
| CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND | 15,890 | 1,564.750 | 24,863,877.50 | |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | 3,636 | 4,433.000 | 16,118,388.00 | |
| JIO FINANCIAL SERVICES LTD | 117,174 | 348.800 | 40,870,291.20 | |
| MUTHOOT FINANCE LTD | 4,186 | 2,013.600 | 8,428,929.60 | |
| POWER FINANCE CORPORATION | 61,445 | 491.050 | 30,172,567.25 | |
| REC LTD | 55,630 | 560.700 | 31,191,741.00 | |
| SBI CARDS & PAYMENT SERVICES | 10,068 | 800.500 | 8,059,434.00 | |
| SHRIRAM FINANCE LTD | 11,734 | 3,418.950 | 40,117,959.30 | |
| SUNDARAM FINANCE LTD | 2,718 | 4,903.200 | 13,326,897.60 | |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | 41,129 | 701.350 | 28,845,824.15 | |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURA | 9,130 | 2,094.900 | 19,126,437.00 | |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA | 12,502 | 749.900 | 9,375,249.80 | |
| PB FINTECH LTD | 12,666 | 1,797.200 | 22,763,335.20 | |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD | 19,037 | 1,821.250 | 34,671,136.25 | |
| HCL TECHNOLOGIES LTD | 37,770 | 1,811.850 | 68,433,574.50 | |
| INFOSYS LTD | 135,071 | 1,950.250 | 263,422,217.75 | |
| LTIMINDTREE LTD | 3,273 | 6,423.450 | 21,023,951.85 | |
| MPHASIS LTD | 4,655 | 3,125.750 | 14,550,366.25 | |
| ORACLE FINANCIAL SERVICES | 882 | 12,239.100 | 10,794,886.20 | |
| PERSISTENT SYSTEMS LTD | 4,385 | 5,301.000 | 23,244,885.00 | |
| TATA CONSULTANCY SVCS LTD | 37,071 | 4,513.250 | 167,310,690.75 | |
| TATA ELXSI LTD | 1,296 | 7,688.750 | 9,964,620.00 | |
| TECH MAHINDRA LTD | 21,364 | 1,649.000 | 35,229,236.00 | |
| WIPRO LTD | 53,173 | 551.900 | 29,346,178.70 | |
| BHARTI AIRTEL LTD | 105,011 | 1,635.450 | 171,740,239.95 | |
| INDUS TOWERS LTD | 52,261 | 428.700 | 22,404,290.70 | |
| TATA COMMUNICATIONS LTD | 4,533 | 2,047.500 | 9,281,317.50 | |
| VODAFONE IDEA LTD | 1,045,879 | 13.240 | 13,847,437.96 | |
| ADANI GREEN ENERGY LTD | 12,008 | 1,930.800 | 23,185,046.40 | |
| ADANI POWER LTD | 29,195 | 665.950 | 19,442,410.25 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | GAIL INDIA LTD | 87,099 | 217.830 | 18,972,775.17 | |
| | JSW ENERGY LTD | 13,899 | 771.600 | 10,724,468.40 | |
| | NHPC LTD | 120,274 | 96.190 | 11,569,156.06 | |
| | NTPC LTD | 173,525 | 411.100 | 71,336,127.50 | |
| | POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 184,930 | 338.250 | 62,552,572.50 | |
| | TATA POWER CO LTD | 61,507 | 443.350 | 27,269,128.45 | |
| | TORRENT POWER LTD | 6,689 | 1,780.800 | 11,911,771.20 | |
| | INFO EDGE INDIA LTD | 2,865 | 7,903.800 | 22,644,387.00 | |
| | DLF LTD | 29,330 | 862.100 | 25,285,393.00 | |
| | GODREJ PROPERTIES LTD | 5,192 | 2,838.500 | 14,737,492.00 | |
| | MACROTECH DEVELOPERS LTD | 11,864 | 1,276.000 | 15,138,464.00 | |
| | PHOENIX MILLS LTD | 4,304 | 3,532.250 | 15,202,804.00 | |
| | PRESTIGE ESTATES PROJECTS | 6,459 | 1,834.900 | 11,851,619.10 | |
| インド・ルピー小計 | | 7,514,658 | | 5,425,493,967.99<br>(9,169,084,806) | |
| インドネシア・ルピア | ADARO ENERGY INDONESIA TBK P | 658,700 | 3,670.000 | 2,417,429,000.00 | |
| | UNITED TRACTORS TBK PT | 65,100 | 26,350.000 | 1,715,385,000.00 | |
| | AMMAN MINERAL INTERNASIONAL | 278,700 | 10,325.000 | 2,877,577,500.00 | |
| | BARITO PACIFIC TBK PT | 1,349,151 | 1,140.000 | 1,538,032,140.00 | |
| | CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT | 335,100 | 9,000.000 | 3,015,900,000.00 | |
| | INDAH KIAT PULP & PAPER TBK | 90,200 | 8,375.000 | 755,425,000.00 | |
| | MERDEKA COPPER GOLD TBK PT | 380,461 | 2,290.000 | 871,255,690.00 | |
| | ASTRA INTERNATIONAL TBK PT | 858,900 | 5,075.000 | 4,358,917,500.00 | |
| | GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT | 39,296,900 | 61.000 | 2,397,110,900.00 | |
| | SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P | 716,700 | 3,150.000 | 2,257,605,000.00 | |
| | CHAROEN POKPHAND INDONESI PT | 260,300 | 4,800.000 | 1,249,440,000.00 | |
| | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T | 71,100 | 11,325.000 | 805,207,500.00 | |
| | INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P | 143,900 | 7,100.000 | 1,021,690,000.00 | |
| | UNILEVER INDONESIA TBK PT | 240,800 | 2,200.000 | 529,760,000.00 | |
| | KALBE FARMA TBK PT | 973,100 | 1,705.000 | 1,659,135,500.00 | |
| | BANK CENTRAL ASIA TBK PT | 2,231,900 | 10,425.000 | 23,267,557,500.00 | |
| | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT | 1,551,700 | 7,275.000 | 11,288,617,500.00 | |
| | BANK NEGARA INDONESIA PERSER | 599,600 | 5,625.000 | 3,372,750,000.00 | |
| | BANK RAKYAT INDONESIA PERSER | 2,765,400 | 5,300.000 | 14,656,620,000.00 | |
| | TELKOM INDONESIA PERSERO TBK | 1,927,000 | 3,110.000 | 5,992,970,000.00 | |
| インドネシア・ルピア小計 | | 54,794,712 | | 86,048,385,730.00<br>(791,645,149) | |
| ブラジル・レアル | COSAN SA | 42,588 | 13.130 | 559,180.44 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS | 149,900 | 40.770 | 6,111,423.00 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 184,400 | 37.210 | 6,861,524.00 | |
| | PRIO SA | 34,500 | 42.740 | 1,474,530.00 | |
| | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 26,800 | 23.070 | 618,276.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 20,900 | 11.910 | 248,919.00 | |
| | GERDAU SA-PREF | 50,928 | 18.480 | 941,149.44 | |
| | SUZANO SA | 31,215 | 53.020 | 1,655,019.30 | |
| | VALE SA | 139,888 | 58.500 | 8,183,448.00 | |
| | EMBRAER SA | 30,500 | 49.180 | 1,499,990.00 | |
| | WEG SA | 68,260 | 53.000 | 3,617,780.00 | |
| | CCR SA | 46,500 | 13.140 | 611,010.00 | |
| | LOCALIZA RENT A CAR | 35,730 | 43.790 | 1,564,616.70 | |
| | RUMO SA | 56,700 | 21.110 | 1,196,937.00 | |
| | VIBRA ENERGIA SA | 44,080 | 24.740 | 1,090,539.20 | |
| | ATACADAO SA | 19,900 | 8.950 | 178,105.00 | |
| | RAIA DROGASIL SA | 51,280 | 27.000 | 1,384,560.00 | |
| | SENDAS DISTRIBUIDORA SA | 55,700 | 8.750 | 487,375.00 | |
| | AMBEV SA | 199,000 | 12.860 | 2,559,140.00 | |
| | BRF SA | 27,400 | 25.000 | 685,000.00 | |
| | JBS SA | 29,700 | 33.590 | 997,623.00 | |
| | NATURA &CO HOLDING SA | 38,000 | 14.250 | 541,500.00 | |
| | HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE | 213,319 | 4.620 | 985,533.78 | |
| | REDE D'OR SAO LUIZ SA | 33,700 | 34.440 | 1,160,628.00 | |
| | HYPERA SA | 13,000 | 29.060 | 377,780.00 | |
| | BANCO BRADESCO S.A. | 59,481 | 13.880 | 825,596.28 | |
| | BANCO BRADESCO SA-PREF | 221,536 | 15.430 | 3,418,300.48 | |
| | BANCO DO BRASIL S.A. | 71,200 | 28.570 | 2,034,184.00 | |
| | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 195,100 | 37.000 | 7,218,700.00 | |
| | ITAUSA SA | 211,580 | 11.200 | 2,369,696.00 | |
| | B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 231,600 | 12.160 | 2,816,256.00 | |
| | BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 26,200 | 36.400 | 953,680.00 | |
| | CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO | 27,300 | 15.210 | 415,233.00 | |
| | TOTVS SA | 22,800 | 30.260 | 689,928.00 | |
| | TELEFONICA BRASIL S.A. | 16,800 | 55.800 | 937,440.00 | |
| | TIM SA | 29,400 | 18.660 | 548,604.00 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 47,305 | 42.000 | 1,986,810.00 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 8,000 | 46.200 | 369,600.00 | |
| | CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 68,508 | 11.740 | 804,283.92 | |
| | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | 19,000 | 96.500 | 1,833,500.00 | |
| | COMPANHIA PARANAENSE -PREF B | 51,700 | 10.820 | 559,394.00 | |
| | CPFL ENERGIA SA | 7,300 | 34.260 | 250,098.00 | |
| | ENGIE BRASIL ENERGIA SA | 6,450 | 44.270 | 285,541.50 | |
| | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 49,900 | 34.060 | 1,699,594.00 | |
| ブラジル・レアル小計 | | 3,015,048 | | 75,608,026.04<br>(1,930,189,736) | |
| チェコ・コ | KOMERCNI BANKA AS | 2,663 | 769.000 | 2,047,847.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| ルナ | MONETA MONEY BANK AS | 12,093 | 110.000 | 1,330,230.00 | |
| | CEZ AS | 6,730 | 855.500 | 5,757,515.00 | |
| チェコ・コルナ小計 | | 21,486 | | 9,135,592.00<br>(56,832,518) | |
| 韓国・ウォン | HD HYUNDAI | 2,022 | 78,700.000 | 159,131,400.00 | |
| | SK INNOVATION CO LTD | 2,672 | 110,700.000 | 295,790,400.00 | |
| | S-OIL CORP | 1,775 | 59,700.000 | 105,967,500.00 | |
| | ENCHEM CO LTD | 519 | 183,300.000 | 95,132,700.00 | |
| | HANWHA SOLUTIONS CORP | 5,063 | 24,600.000 | 124,549,800.00 | |
| | HYUNDAI STEEL CO | 2,767 | 24,500.000 | 67,791,500.00 | |
| | KOREA ZINC CO LTD | 371 | 666,000.000 | 247,086,000.00 | |
| | KUM YANG CO LTD | 1,245 | 48,500.000 | 60,382,500.00 | |
| | KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD | 531 | 133,300.000 | 70,782,300.00 | |
| | LG CHEM LTD | 2,074 | 321,500.000 | 666,791,000.00 | |
| | LG CHEM LTD-PREFERENCE | 227 | 213,500.000 | 48,464,500.00 | |
| | LOTTE CHEMICAL CORP | 723 | 80,600.000 | 58,273,800.00 | |
| | POSCO HOLDINGS INC | 2,913 | 370,000.000 | 1,077,810,000.00 | |
| | SKC CO LTD | 898 | 123,800.000 | 111,172,400.00 | |
| | DOOSAN BOBCAT INC | 2,210 | 41,350.000 | 91,383,500.00 | |
| | DOOSAN ENERBILITY CO LTD | 16,971 | 18,160.000 | 308,193,360.00 | |
| | ECOPRO BM CO LTD | 1,920 | 159,100.000 | 305,472,000.00 | |
| | ECOPRO CO LTD | 3,930 | 76,800.000 | 301,824,000.00 | |
| | ECOPRO MATERIALS CO LTD | 616 | 103,600.000 | 63,817,600.00 | |
| | GS HOLDINGS | 2,131 | 44,700.000 | 95,255,700.00 | |
| | HANWHA AEROSPACE CO LTD | 1,363 | 290,000.000 | 395,270,000.00 | |
| | HANWHA OCEAN CO LTD | 3,632 | 30,600.000 | 111,139,200.00 | |
| | HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD | 930 | 283,500.000 | 263,655,000.00 | |
| | HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES | 830 | 187,600.000 | 155,708,000.00 | |
| | HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS | 1,607 | 183,000.000 | 294,081,000.00 | |
| | HYUNDAI ENGINEERING & CONST | 2,816 | 31,250.000 | 88,000,000.00 | |
| | KOREA AEROSPACE INDUSTRIES | 3,106 | 53,000.000 | 164,618,000.00 | |
| | L&F CO LTD | 1,068 | 90,400.000 | 96,547,200.00 | |
| | LG CORP | 4,097 | 84,000.000 | 344,148,000.00 | |
| | LG ENERGY SOLUTION | 1,956 | 399,500.000 | 781,422,000.00 | |
| | LS ELECTRIC CO LTD | 737 | 145,000.000 | 106,865,000.00 | |
| | POSCO FUTURE M CO LTD | 1,173 | 232,000.000 | 272,136,000.00 | |
| | POSCO INTERNATIONAL CORP | 2,522 | 54,400.000 | 137,196,800.00 | |
| | SAMSUNG C&T CORP | 3,755 | 149,200.000 | 560,246,000.00 | |
| | SAMSUNG E&A CO LTD | 7,079 | 24,150.000 | 170,957,850.00 | |
| | SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES | 27,200 | 10,340.000 | 281,248,000.00 | |
| | SK INC | 1,385 | 147,900.000 | 204,841,500.00 | |
| | SK SQUARE CO LTD | 3,944 | 77,000.000 | 303,688,000.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HMM CO LTD | 10,696 | 16,860.000 | 180,334,560.00 | |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 1,482 | 115,700.000 | 171,467,400.00 | |
| KOREAN AIR LINES CO LTD | 6,388 | 22,400.000 | 143,091,200.00 | |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO | 2,945 | 41,200.000 | 121,334,000.00 | |
| HYUNDAI MOBIS CO LTD | 2,378 | 223,500.000 | 531,483,000.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO | 5,491 | 237,000.000 | 1,301,367,000.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF | 1,565 | 176,500.000 | 276,222,500.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF | 913 | 173,000.000 | 157,949,000.00 | |
| KIA CORP | 9,951 | 100,500.000 | 1,000,075,500.00 | |
| COWAY CO LTD | 1,996 | 66,100.000 | 131,935,600.00 | |
| LG ELECTRONICS INC | 4,419 | 104,400.000 | 461,343,600.00 | |
| HANJIN KAL CORP | 1,262 | 71,000.000 | 89,602,000.00 | |
| CJ CHEILJEDANG CORP | 261 | 317,000.000 | 82,737,000.00 | |
| KT&G CORP | 4,383 | 111,500.000 | 488,704,500.00 | |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA | 1,190 | 89,000.000 | 105,910,000.00 | |
| AMOREPACIFIC CORP | 1,133 | 140,600.000 | 159,299,800.00 | |
| LG H&H | 359 | 350,000.000 | 125,650,000.00 | |
| HLB INC | 4,671 | 89,200.000 | 416,653,200.00 | |
| ALTEOGEN INC | 1,692 | 319,500.000 | 540,594,000.00 | |
| CELLTRION INC | 6,183 | 195,200.000 | 1,206,921,600.00 | |
| CELLTRION PHARM INC | 857 | 68,200.000 | 58,447,400.00 | |
| HANMI PHARM CO LTD | 246 | 323,500.000 | 79,581,000.00 | |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD | 745 | 990,000.000 | 737,550,000.00 | |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD | 1,453 | 104,300.000 | 151,547,900.00 | |
| SK BIOSCIENCE CO LTD | 902 | 55,500.000 | 50,061,000.00 | |
| YUHAN CORP | 2,342 | 125,000.000 | 292,750,000.00 | |
| HANA FINANCIAL GROUP | 11,955 | 60,700.000 | 725,668,500.00 | |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA | 11,154 | 13,890.000 | 154,929,060.00 | |
| KAKAOBANK CORP | 6,317 | 21,400.000 | 135,183,800.00 | |
| KB FINANCIAL GROUP INC | 15,500 | 81,800.000 | 1,267,900,000.00 | |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD | 17,971 | 55,900.000 | 1,004,578,900.00 | |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC | 26,970 | 15,420.000 | 415,877,400.00 | |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 1,369 | 72,900.000 | 99,800,100.00 | |
| MERITZ FINANCIAL GROUP INC | 3,907 | 93,100.000 | 363,741,700.00 | |
| MIRAE ASSET SECURITIES CO LT | 8,457 | 8,700.000 | 73,575,900.00 | |
| NH INVESTMENT & SECURITIES C | 5,391 | 14,180.000 | 76,444,380.00 | |
| DB INSURANCE CO LTD | 1,789 | 112,600.000 | 201,441,400.00 | |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INS | 1,227 | 357,500.000 | 438,652,500.00 | |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT | 3,201 | 97,500.000 | 312,097,500.00 | |
| POSCO DX CO LTD | 1,864 | 29,350.000 | 54,708,400.00 | |
| SAMSUNG SDS CO LTD | 1,822 | 164,800.000 | 300,265,600.00 | |
| COSMOAM&T CO LTD | 821 | 109,300.000 | 89,735,300.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | LG DISPLAY CO LTD | 11,601 | 10,520.000 | 122,042,520.00 | |
| | LG INNOTEK CO LTD | 495 | 231,500.000 | 114,592,500.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO | 2,356 | 130,700.000 | 307,929,200.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 194,488 | 64,400.000 | 12,525,027,200.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF | 33,810 | 52,500.000 | 1,775,025,000.00 | |
| | SAMSUNG SDI CO LTD | 2,241 | 365,000.000 | 817,965,000.00 | |
| | HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD | 1,863 | 99,500.000 | 185,368,500.00 | |
| | SK HYNIX INC | 22,327 | 162,800.000 | 3,634,835,600.00 | |
| | KT CORP | 1,784 | 42,050.000 | 75,017,200.00 | |
| | LG UPLUS CORP | 6,942 | 10,000.000 | 69,420,000.00 | |
| | SK TELECOM | 2,212 | 58,300.000 | 128,959,600.00 | |
| | KOREA ELECTRIC POWER CORP | 9,785 | 22,250.000 | 217,716,250.00 | |
| | HYBE CO LTD | 801 | 164,000.000 | 131,364,000.00 | |
| | KAKAO CORP | 12,106 | 35,600.000 | 430,973,600.00 | |
| | KRAFTON INC | 1,234 | 338,000.000 | 417,092,000.00 | |
| | NAVER CORP | 5,285 | 160,100.000 | 846,128,500.00 | |
| | NCSOFT CORP | 485 | 179,800.000 | 87,203,000.00 | |
| | NETMARBLE CORP | 1,568 | 60,700.000 | 95,177,600.00 | |
| 韓国・ウォン小計 | | 627,779 | | 45,845,889,980.00<br>(4,891,756,461) | |
| マレーシア・リンギット | PETRONAS DAGANGAN BHD | 10,400 | 19.080 | 198,432.00 | |
| | PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 105,000 | 5.500 | 577,500.00 | |
| | PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN | 140,100 | 4.780 | 669,678.00 | |
| | GAMUDA BHD | 84,800 | 7.590 | 643,632.00 | |
| | SIME DARBY BERHAD | 93,800 | 2.320 | 217,616.00 | |
| | SUNWAY BHD | 92,600 | 4.090 | 378,734.00 | |
| | MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD | 30,900 | 10.500 | 324,450.00 | |
| | MISC BHD | 61,600 | 8.040 | 495,264.00 | |
| | GENTING BHD | 78,200 | 4.210 | 329,222.00 | |
| | GENTING MALAYSIA BHD | 124,300 | 2.450 | 304,535.00 | |
| | MR DIY GROUP M BHD | 136,150 | 1.960 | 266,854.00 | |
| | IOI CORP BHD | 101,000 | 3.860 | 389,860.00 | |
| | KUALA LUMPUR KEPONG BHD | 21,300 | 20.780 | 442,614.00 | |
| | NESTLE (MALAYSIA) BERHAD | 2,300 | 101.300 | 232,990.00 | |
| | PPB GROUP BERHAD | 30,140 | 14.200 | 427,988.00 | |
| | QL RESOURCES BHD | 54,350 | 6.780 | 368,493.00 | |
| | SD GUTHRIE BHD | 80,400 | 4.540 | 365,016.00 | |
| | IHH HEALTHCARE BHD | 85,700 | 6.780 | 581,046.00 | |
| | AMMB HOLDINGS BHD | 108,500 | 5.170 | 560,945.00 | |
| | CIMB GROUP HOLDINGS BHD | 286,100 | 8.160 | 2,334,576.00 | |
| | HONG LEONG BANK BERHAD | 22,700 | 21.200 | 481,240.00 | |
| | MALAYAN BANKING BHD | 227,100 | 10.640 | 2,416,344.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | PUBLIC BANK BERHAD | 605,200 | 4.700 | 2,844,440.00 | |
| | RHB BANK BHD | 73,100 | 6.300 | 460,530.00 | |
| | INARI AMERTRON BHD | 125,200 | 3.040 | 380,608.00 | |
| | AXIATA GROUP BERHAD | 89,500 | 2.500 | 223,750.00 | |
| | CELCOMDIGI BHD | 123,800 | 3.700 | 458,060.00 | |
| | MAXIS BHD | 85,300 | 3.840 | 327,552.00 | |
| | TELEKOM MALAYSIA BHD | 56,700 | 6.700 | 379,890.00 | |
| | PETRONAS GAS BHD | 30,700 | 17.980 | 551,986.00 | |
| | TENAGA NASIONAL BHD | 104,400 | 14.780 | 1,543,032.00 | |
| | YTL CORP BHD | 149,000 | 2.550 | 379,950.00 | |
| | YTL POWER INTERNATIONAL BHD | 108,600 | 3.660 | 397,476.00 | |
| マレーシア・リンギット小計 | | 3,528,940 | | 20,954,303.00<br>(686,259,710) | |
| 南アフリカ・ランド | EXXARO RESOURCES LTD | 11,192 | 155.040 | 1,735,207.68 | |
| | ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD | 2,321 | 556.810 | 1,292,356.01 | |
| | ANGLOGOLD ASHANTI PLC | 16,779 | 496.410 | 8,329,263.39 | |
| | GOLD FIELDS LTD | 36,395 | 255.900 | 9,313,480.50 | |
| | HARMONY GOLD MINING CO LTD | 23,472 | 175.350 | 4,115,815.20 | |
| | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 38,529 | 91.020 | 3,506,909.58 | |
| | KUMBA IRON ORE LTD | 2,544 | 349.860 | 890,043.84 | |
| | NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT | 14,047 | 104.360 | 1,465,944.92 | |
| | SASOL LTD | 24,977 | 124.600 | 3,112,134.20 | |
| | SIBANYE STILLWATER LTD | 119,878 | 18.210 | 2,182,978.38 | |
| | BIDVEST GROUP LTD | 14,536 | 274.390 | 3,988,533.04 | |
| | NASPERS LTD-N SHS | 7,250 | 3,478.000 | 25,215,500.00 | |
| | PEPKOR HOLDINGS LTD | 97,392 | 22.400 | 2,181,580.80 | |
| | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 38,194 | 63.000 | 2,406,222.00 | |
| | BID CORP LTD | 13,980 | 438.300 | 6,127,434.00 | |
| | CLICKS GROUP LTD | 9,867 | 370.240 | 3,653,158.08 | |
| | SHOPRITE HOLDINGS LTD | 21,011 | 297.940 | 6,260,017.34 | |
| | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 15,681 | 193.490 | 3,034,116.69 | |
| | ABSA GROUP LTD | 34,551 | 169.380 | 5,852,248.38 | |
| | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 3,583 | 2,982.500 | 10,686,297.50 | |
| | NEDBANK GROUP LTD | 19,433 | 288.240 | 5,601,367.92 | |
| | STANDARD BANK GROUP LTD | 54,772 | 232.600 | 12,739,967.20 | |
| | FIRSTRAND LTD | 204,749 | 82.720 | 16,936,837.28 | |
| | REINET INVESTMENTS SCA | 4,918 | 468.890 | 2,306,001.02 | |
| | REMGRO LTD | 19,028 | 145.780 | 2,773,901.84 | |
| | DISCOVERY LTD | 22,003 | 154.990 | 3,410,244.97 | |
| | OLD MUTUAL LTD | 170,915 | 12.500 | 2,136,437.50 | |
| | OUTSURANCE GROUP LTD | 34,388 | 51.050 | 1,755,507.40 | |
| | SANLAM LTD | 70,266 | 85.650 | 6,018,282.90 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | MTN GROUP LTD | 67,043 | 92.520 | 6,202,818.36 | |
| | VODACOM GROUP LTD | 25,348 | 110.790 | 2,808,304.92 | |
| | NEPI ROCKCASTLE N.V. | 23,182 | 148.810 | 3,449,713.42 | |
| 南アフリカ・ランド小計 | | 1,262,224 | | 171,488,626.26<br>(1,368,479,238) | |
| タイ・バーツ | PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR | 56,500 | 137.000 | 7,740,500.00 | |
| | PTT PCL-NVDR | 391,900 | 33.250 | 13,030,675.00 | |
| | THAI OIL PCL-NVDR | 52,500 | 51.250 | 2,690,625.00 | |
| | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 78,600 | 28.750 | 2,259,750.00 | |
| | SCG PACKAGING PCL-NVDR | 41,600 | 27.500 | 1,144,000.00 | |
| | SIAM CEMENT PCL-NVDR | 31,300 | 249.000 | 7,793,700.00 | |
| | AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR | 178,800 | 62.750 | 11,219,700.00 | |
| | BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR | 348,900 | 8.000 | 2,791,200.00 | |
| | MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 126,300 | 28.500 | 3,599,550.00 | |
| | CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR | 63,391 | 32.250 | 2,044,359.75 | |
| | HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 235,400 | 10.800 | 2,542,320.00 | |
| | PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR | 110,600 | 17.000 | 1,880,200.00 | |
| | CP ALL PCL-NVDR | 229,200 | 65.500 | 15,012,600.00 | |
| | CP AXTRA PCL-NVDR | 77,100 | 33.000 | 2,544,300.00 | |
| | CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR | 154,600 | 24.600 | 3,803,160.00 | |
| | BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR | 455,100 | 29.750 | 13,539,225.00 | |
| | BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR | 22,300 | 270.000 | 6,021,000.00 | |
| | KASIKORNBANK PCL-NVDR | 23,700 | 157.500 | 3,732,750.00 | |
| | KRUNG THAI BANK - NVDR | 171,100 | 20.400 | 3,490,440.00 | |
| | SCB X PCL-NVDR | 30,600 | 112.000 | 3,427,200.00 | |
| | TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR | 1,077,800 | 1.960 | 2,112,488.00 | |
| | KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR | 50,200 | 46.500 | 2,334,300.00 | |
| | DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR | 130,500 | 102.500 | 13,376,250.00 | |
| | ADVANCED INFO SERVICE-NVDR | 49,900 | 256.000 | 12,774,400.00 | |
| | INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR | 35,900 | 89.250 | 3,204,075.00 | |
| | TRUE CORP PCL/NEW-NVDR | 474,567 | 10.700 | 5,077,866.90 | |
| | GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR | 130,000 | 55.750 | 7,247,500.00 | |
| | CENTRAL PATTANA PCL-NVDR | 76,200 | 65.500 | 4,991,100.00 | |
| タイ・バーツ小計 | | 4,904,558 | | 161,425,234.65<br>(682,828,743) | |
| ポーランド・ズロチ | ORLEN SA | 23,604 | 60.700 | 1,432,762.80 | |
| | KGHM POLSKA MIEDZ SA | 5,950 | 138.600 | 824,670.00 | |
| | BUDIMEX | 546 | 595.500 | 325,143.00 | |
| | LPP SA | 48 | 14,540.000 | 697,920.00 | |
| | ALLEGRO.EU SA | 23,505 | 37.800 | 888,489.00 | |
| | DINO POLSKA SA | 1,969 | 303.300 | 597,197.70 | |
| | ALIOR BANK SA | 4,307 | 92.940 | 400,292.58 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | BANK PEKAO SA | 7,306 | 148.850 | 1,087,498.10 | |
| | MBANK SA | 477 | 634.400 | 302,608.80 | |
| | PKO BANK POLSKI SA | 36,275 | 55.820 | 2,024,870.50 | |
| | SANTANDER BANK POLSKA SA | 1,451 | 463.000 | 671,813.00 | |
| | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 23,952 | 39.150 | 937,720.80 | |
| | PGE SA | 36,813 | 7.172 | 264,022.83 | |
| | CD PROJEKT SA | 2,415 | 172.900 | 417,553.50 | |
| ポーランド・ズロチ小計 | | 168,618 | | 10,872,562.61<br>(397,900,998) | |
| ハンガリー・フォリント | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL | 17,123 | 2,636.000 | 45,136,228.00 | |
| | RICHTER GEDEON NYRT | 5,767 | 10,750.000 | 61,995,250.00 | |
| | OTP BANK PLC | 8,992 | 18,500.000 | 166,352,000.00 | |
| ハンガリー・フォリント小計 | | 31,882 | | 273,483,478.00<br>(108,566,376) | |
| ユーロ | METLEN ENERGY & METALS SA | 4,436 | 33.440 | 148,339.84 | |
| | FF GROUP | 123 | 4.800 | 590.40 | |
| | OPAP SA | 7,358 | 15.950 | 117,360.10 | |
| | JUMBO SA | 4,834 | 24.280 | 117,369.52 | |
| | ALPHA SERVICES AND HOLDINGS | 91,747 | 1.549 | 142,116.10 | |
| | EUROBANK ERGASIAS SERVICES A | 105,462 | 1.980 | 208,814.76 | |
| | NATIONAL BANK OF GREECE | 32,591 | 7.384 | 240,651.94 | |
| | PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S | 40,213 | 3.850 | 154,820.05 | |
| | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 7,649 | 15.040 | 115,040.96 | |
| | PUBLIC POWER CORP | 8,551 | 11.280 | 96,455.28 | |
| ユーロ小計 | | 302,964 | | 1,341,558.95<br>(210,021,054) | |
| 合　計 | | 140,292,447 | | 39,236,619,466<br>(39,236,619,466) | |

(注) 金額欄の(　)内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 通　貨 | 銘柄数 | | 組入株式時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 株式 | 22銘柄 | 2.5% | 3.0% |
| 香港・ドル | 株式 | 151銘柄 | 17.2% | 20.7% |
| 台湾・ドル | 株式 | 87銘柄 | 17.2% | 20.7% |
| エジプト・ポンド | 株式 | 3銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| トルコ・リラ | 株式 | 18銘柄 | 0.6% | 0.8% |
| メキシコ・ペソ | 株式 | 20銘柄 | 1.4% | 1.7% |
| フィリピン・ペソ | 株式 | 13銘柄 | 0.6% | 0.7% |
| チリ・ペソ | 株式 | 11銘柄 | 0.4% | 0.5% |
| コロンビア・ペソ | 株式 | 3銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| インド・ルピー | 株式 | 151銘柄 | 19.4% | 23.4% |
| インドネシア・ルピア | 株式 | 20銘柄 | 1.7% | 2.0% |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ブラジル・レアル | 株式 | 44銘柄 | 4.1% | 4.9% |
| チェコ・コルナ | 株式 | 3銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| 韓国・ウォン | 株式 | 98銘柄 | 10.3% | 12.5% |
| マレーシア・リンギット | 株式 | 33銘柄 | 1.4% | 1.7% |
| 南アフリカ・ランド | 株式 | 32銘柄 | 2.9% | 3.5% |
| タイ・バーツ | 株式 | 28銘柄 | 1.4% | 1.7% |
| ポーランド・ズロチ | 株式 | 14銘柄 | 0.8% | 1.0% |
| ハンガリー・フォリント | 株式 | 3銘柄 | 0.2% | 0.3% |
| ユーロ | 株式 | 10銘柄 | 0.4% | 0.5% |

(b)株式以外の有価証券

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資信託受益証券 | オフショア・人民元 | CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY | 2,368,000.00 | 77,433,600.00 | |
| | オフショア・人民元小計 | | 2,368,000.00 | 77,433,600.00<br>(1,534,261,607) | |
| 投資信託受益証券合計 | | | | 1,534,261,607<br>(1,534,261,607) | |
| 投資証券 | アメリカ・ドル | ISHARES MSCI KUWAIT ETF | 70,532.00 | 2,293,700.64 | |
| | | ISHARES MSCI QATAR ETF | 141,785.00 | 2,580,487.00 | |
| | | ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | 299,238.00 | 12,343,567.50 | |
| | | ISHARES MSCI UAE ETF | 256,688.00 | 3,873,421.92 | |
| | アメリカ・ドル小計 | | 768,243.00 | 21,091,177.06<br>(2,969,004,995) | |
| | メキシコ・ペソ | CEMEX SAB-CPO | 642,700.00 | 7,448,893.00 | |
| | | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 20,875.00 | 3,497,188.75 | |
| | | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 74,500.00 | 14,941,720.00 | |
| | | PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA | 45,560.00 | 2,923,129.60 | |
| | | TRUST FIBRA UNO | 117,000.00 | 2,626,650.00 | |
| | メキシコ・ペソ小計 | | 900,635.00 | 31,437,581.35<br>(230,069,652) | |
| | ブラジル・レアル | BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | 49,300.00 | 1,739,797.00 | |
| | | ENERGISA SA-UNITS | 11,000.00 | 531,520.00 | |
| | | KLABIN SA - UNIT | 34,430.00 | 747,819.60 | |
| | ブラジル・レアル小計 | | 94,730.00 | 3,019,136.60<br>(77,075,236) | |
| 投資証券合計 | | | | 3,276,149,883<br>(3,276,149,883) | |
| 合　計 | | | | 4,810,411,490<br>(4,810,411,490) | |

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 通　貨 | 銘柄数 | | 組入<br>投資信託受益証券<br>時価比率 | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 投資証券 | 4銘柄 | － | 6.3% | 61.7% |
| メキシコ・ペソ | 投資証券 | 5銘柄 | － | 0.5% | 4.8% |
| ブラジル・レアル | 投資証券 | 3銘柄 | － | 0.2% | 1.6% |
| オフショア・人民元 | 投資信託受益証券 | 1銘柄 | 3.2% | － | 31.9% |

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

Ｊリート・インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

| | （2024年9月17日現在） |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 金銭信託 | 1,441,190 |
| コール・ローン | 143,288,588 |
| 投資証券 | 15,569,551,000 |
| 未収配当金 | 222,744,759 |
| 前払金 | 108,000 |
| 差入委託証拠金 | 2,163,770 |
| 流動資産合計 | 15,939,297,307 |
| 資産合計 | 15,939,297,307 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 72,400 |
| 未払金 | 95,458,028 |
| 未払解約金 | 11,491,761 |
| 流動負債合計 | 107,022,189 |
| 負債合計 | 107,022,189 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 6,047,916,666 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 9,784,358,452 |
| 元本等合計 | 15,832,275,118 |
| 純資産合計 | 15,832,275,118 |
| 負債純資産合計 | 15,939,297,307 |

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | (2024年9月17日現在) |
|---|---|
| １．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 6,047,916,666口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　2.6178円<br>（１万口当たりの純資産額26,178円） |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

| 項　目 | 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| １．　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| ２．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容<br>1) 有価証券<br>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。 |

| | |
|---|---|
| | 2) デリバティブ取引<br>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。<br>当計算期間については、先物取引を行っております。<br>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>(2) 金融商品に係るリスク<br>有価証券およびデリバティブ取引等<br>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。<br>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。<br>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。 |

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | (2024年9月17日現在) |
|---|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券（投資証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 |

| | |
|---|---|
| | (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | リート指数先物取引<br>買建<br>TREIT 先物 0612 月 | 35,002,400 | - | 34,930,000 | △72,400 |
| | 小計 | 35,002,400 | - | 34,930,000 | △72,400 |
| 合計 | | 35,002,400 | - | 34,930,000 | △72,400 |

(注) 1．時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| (2024年9月17日現在) | |
|---|---|
| 開示対象ファンドの<br>期首における当該親投資信託の元本額 | 5,033,491,862円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,858,545,945円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,844,121,141円 |
| 2024年9月17日現在の元本の内訳<br>アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 62,443,375円 |

| | |
|---|---|
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 143,794,181円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 104,273,357円 |
| 三井住友・ＤＣ日本リートインデックスファンド | 2,829,637,094円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０ | 32,189,464円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 48,821,857円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 52,586,537円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 239,482,273円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 156,128,374円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 127,306,138円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 61,188,113円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０ | 4,457,083円 |
| 三井住友ＤＳ・国内リートインデックス年金ファンド | 398,251,532円 |
| 日興ＦＷＳ・Ｊリートインデックス | 1,131,384,417円 |
| 三井住友ＤＳ・国内リートインデックス・ファンド | 190,356,944円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５ | 6,123,718円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０ | 4,111,113円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５ | 5,773,534円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５ | 3,711,895円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５ | 2,393,809円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 415,601円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 18,223,704円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 95,461,417円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 102,437,174円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 40,514,770円 |
| ＳＭＡＭ・世界リート・インデックスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 2,641,141円 |
| ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 69,740,411円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞ | 43,842,620円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞ | 70,225,020円 |
| 合　計 | 6,047,916,666円 |

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種　類 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| 投資証券 | エスコンジャパンリート投資法人 | 340 | 40,970,000 | |
| | サンケイリアルエステート投資法人 | 490 | 39,249,000 | |
| | ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人 | 764 | 87,936,400 | |
| | 東海道リート投資法人 | 260 | 29,510,000 | |
| | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 527 | 347,293,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 森ヒルズリート投資法人 | 1,800 | 228,960,000 | |
| | 産業ファンド投資法人 | 2,803 | 338,602,400 | |
| | アドバンス・レジデンス投資法人 | 1,505 | 506,432,500 | |
| | アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 745 | 242,870,000 | |
| | ＧＬＰ投資法人 | 5,142 | 695,198,400 | |
| | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 774 | 256,968,000 | |
| | 日本プロロジスリート投資法人 | 2,666 | 714,754,600 | |
| | 星野リゾート・リート投資法人 | 322 | 153,433,000 | |
| | Ｏｎｅリート投資法人 | 267 | 65,895,600 | |
| | イオンリート投資法人 | 1,878 | 253,717,800 | |
| | ヒューリックリート投資法人 | 1,352 | 189,550,400 | |
| | 日本リート投資法人 | 497 | 157,549,000 | |
| | 積水ハウス・リート投資法人 | 4,601 | 369,920,400 | |
| | トーセイ・リート投資法人 | 333 | 45,621,000 | |
| | ヘルスケア＆メディカル投資法人 | 378 | 44,377,200 | |
| | サムティ・レジデンシャル投資法人 | 391 | 39,569,200 | |
| | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 4,949 | 748,783,700 | |
| | いちごホテルリート投資法人 | 252 | 30,668,400 | |
| | ラサールロジポート投資法人 | 1,960 | 283,808,000 | |
| | スターアジア不動産投資法人 | 2,820 | 148,896,000 | |
| | マリモ地方創生リート投資法人 | 277 | 32,270,500 | |
| | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 639 | 278,284,500 | |
| | 日本ホテル＆レジデンシャル投資法人 | 246 | 17,712,000 | |
| | 投資法人みらい | 2,108 | 92,014,200 | |
| | 三菱地所物流リート投資法人 | 528 | 197,736,000 | |
| | ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人 | 659 | 98,915,900 | |
| | ザイマックス・リート投資法人 | 261 | 30,041,100 | |
| | タカラレーベン不動産投資法人 | 997 | 86,938,400 | |
| | アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 671 | 83,472,400 | |
| | 日本ビルファンド投資法人 | 1,785 | 1,206,660,000 | |
| | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 1,571 | 930,032,000 | |
| | 日本都市ファンド投資法人 | 7,711 | 781,124,300 | |
| | オリックス不動産投資法人 | 3,051 | 474,125,400 | |
| | 日本プライムリアルティ投資法人 | 1,047 | 369,591,000 | |
| | ＮＴＴ都市開発リート投資法人 | 1,557 | 181,234,800 | |
| | 東急リアル・エステート投資法人 | 1,028 | 161,601,600 | |
| | グローバル・ワン不動産投資法人 | 1,130 | 115,486,000 | |
| | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 3,425 | 480,527,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 森トラストリート投資法人 | 2,951 | 191,519,900 | |
| | インヴィンシブル投資法人 | 8,435 | 489,230,000 | |
| | フロンティア不動産投資法人 | 567 | 245,511,000 | |
| | 平和不動産リート投資法人 | 1,122 | 144,850,200 | |
| | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 1,030 | 285,722,000 | |
| | 福岡リート投資法人 | 863 | 126,774,700 | |
| | ＫＤＸ不動産投資法人 | 4,283 | 662,151,800 | |
| | いちごオフィスリート投資法人 | 1,116 | 92,739,600 | |
| | 大和証券オフィス投資法人 | 621 | 194,994,000 | |
| | 阪急阪神リート投資法人 | 731 | 91,448,100 | |
| | スターツプロシード投資法人 | 265 | 51,251,000 | |
| | 大和ハウスリート投資法人 | 2,294 | 539,548,800 | |
| | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 5,624 | 385,806,400 | |
| | 大和証券リビング投資法人 | 2,203 | 224,926,300 | |
| | ジャパンエクセレント投資法人 | 1,314 | 164,775,600 | |
| | 投資証券　小計 | | 15,569,551,000 | |
| 合　計 | | | 15,569,551,000 | |

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

| | （2024年9月17日現在） |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 1,312,343,586 |
| 金銭信託 | 3,113,032 |
| コール・ローン | 309,509,424 |
| 投資証券 | 39,923,748,353 |
| 派生商品評価勘定 | 1,431 |
| 未収入金 | 2,371,294 |
| 未収配当金 | 138,503,013 |
| 流動資産合計 | 41,689,590,133 |
| 資産合計 | 41,689,590,133 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,402,297 |
| 未払解約金 | 2,692,818 |
| 流動負債合計 | 4,095,115 |
| 負債合計 | 4,095,115 |
| 純資産の部 | |

| | |
|---|---|
| 元本等 | |
| 元本 | 11,577,053,279 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 30,108,441,739 |
| 元本等合計 | 41,685,495,018 |
| 純資産合計 | 41,685,495,018 |
| 負債純資産合計 | 41,689,590,133 |

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| ３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。 |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | (2024年9月17日現在) |
|---|---|
| １．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 11,577,053,279口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　3.6007円<br>（１万口当たりの純資産額36,007円） |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

| 項　目 | 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| 1．　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容<br>1) 有価証券<br>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。<br>2) デリバティブ取引<br>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。<br>当計算期間については、為替予約取引を行っております。<br>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>(2) 金融商品に係るリスク<br>有価証券およびデリバティブ取引等<br>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |
| 3．　金融商品に係るリスク管理体制 | リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。<br>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。<br>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に |

| | |
|---|---|
| | 実施し、投資対象としての適格性を判断しております。 |

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | (2024年9月17日現在) |
|---|---|
| 1．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（投資証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区　分 | 種　類 | 契　約　額　等 | | 時　価 | 評価損益 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 242,400,000 | － | 241,170,782 | △1,229,218 |
| | カナダ・ドル | 9,000,000 | － | 8,940,332 | △59,668 |
| | オーストラリア・ドル | 18,000,000 | － | 17,948,727 | △51,273 |
| | シンガポール・ドル | 8,800,000 | － | 8,780,283 | △19,717 |
| | イギリス・ポンド | 13,000,000 | － | 12,995,166 | △4,834 |
| | ユーロ | 15,100,000 | － | 15,063,844 | △36,156 |
| | 小計 | 306,300,000 | － | 304,899,134 | △1,400,866 |
| 合　計 | | 306,300,000 | － | 304,899,134 | △1,400,866 |

(注) 1．時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2)計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| (2024年9月17日現在) | |
|---|---|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 9,988,366,894円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,559,789,268円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 971,102,883円 |
| | |
| 2024年9月17日現在の元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 9,287,763円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 14,066,046円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 8,047,360円 |
| 三井住友・ＤＣ外国リートインデックスファンド | 9,060,936,613円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０ | 11,148,089円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 38,740,973円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 38,588,464円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 167,348,435円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 112,510,735円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 94,715,195円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 132,220,140円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０ | 1,569,833円 |
| 三井住友ＤＳ・外国リートインデックス年金ファンド | 442,720,455円 |
| 日興ＦＷＳ・Ｇリートインデックス（為替ヘッジあり） | 61,520,971円 |
| 日興ＦＷＳ・Ｇリートインデックス（為替ヘッジなし） | 1,121,601,869円 |
| 三井住友ＤＳ・先進国リートインデックス・ファンド | 154,761,724円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５ | 3,744,661円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０ | 2,066,872円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５ | 2,234,489円 |

| | |
|---|---|
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５ | 1,250,247円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５ | 817,062円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 60,300円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 1,108,014円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 6,189,308円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 6,844,237円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 2,761,958円 |
| ＳＭＡＭ・世界リート・インデックスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 28,476,244円 |
| ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 51,715,222円 |
| 合　計 | 11,577,053,279円 |

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ・ドル | ACADIA REALTY TRUST | 20,375.00 | 468,828.75 | |
| | | AGREE REALTY CORP | 17,601.00 | 1,350,172.71 | |
| | | ALEXANDER & BALDWIN INC | 12,195.00 | 241,339.05 | |
| | | ALEXANDER'S INC | 300.00 | 73,251.00 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 28,835.00 | 3,596,012.85 | |
| | | ALPINE INCOME PROPERTY TRUST | 2,165.00 | 40,030.85 | |
| | | AMERICAN ASSETS TRUST INC | 10,429.00 | 280,122.94 | |
| | | AMERICAN HEALTHCARE REIT INC | 14,873.00 | 362,603.74 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 59,403.00 | 2,432,552.85 | |
| | | AMERICOLD REALTY TRUST INC | 48,007.00 | 1,374,440.41 | |
| | | APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 23,200.00 | 210,656.00 | |
| | | APPLE HOSPITALITY REIT INC | 40,321.00 | 578,203.14 | |
| | | ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 15,799.00 | 190,377.95 | |
| | | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 2,515.00 | 2,029.60 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 25,857.00 | 6,021,061.02 | |
| | | BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 8,400.00 | 25,620.00 | |
| | | BRANDYWINE REALTY TRUST | 34,607.00 | 187,916.01 | |
| | | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 54,159.00 | 1,524,034.26 | |
| | | BROADSTONE NET LEASE INC | 31,774.00 | 594,809.28 | |
| | | BRT APARTMENTS CORP | 500.00 | 9,540.00 | |
| | | BXP INC | 26,897.00 | 2,192,105.50 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 19,215.00 | 2,400,529.95 | |
| | | CARETRUST REIT INC | 24,090.00 | 751,608.00 | |
| | | CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | 3,648.00 | 92,586.24 | |
| | | CENTERSPACE | 2,600.00 | 191,958.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | CHATHAM LODGING TRUST | 12,827.00 | 106,720.64 | |
| | | CITY OFFICE REIT INC | 4,603.00 | 28,998.90 | |
| | | CLIPPER REALTY INC | 800.00 | 4,192.00 | |
| | | COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 3,216.00 | 57,148.32 | |
| | | COPT DEFENSE PROPERTIES | 20,034.00 | 603,023.40 | |
| | | COUSINS PROPERTIES INC | 28,470.00 | 839,865.00 | |
| | | CTO REALTY GROWTH INC | 3,839.00 | 74,975.67 | |
| | | CUBESMART | 40,256.00 | 2,195,964.80 | |
| | | DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 33,165.00 | 279,912.60 | |
| | | DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT | 178,800.00 | 104,598.00 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 58,588.00 | 9,425,051.56 | |
| | | DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 23,884.00 | 85,265.88 | |
| | | DOUGLAS EMMETT INC | 30,537.00 | 516,380.67 | |
| | | EAGLE HOSPITALITY TRUST | 20,000.00 | 2,740.00 | |
| | | EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 15,924.00 | 218,795.76 | |
| | | EASTGROUP PROPERTIES INC | 8,959.00 | 1,704,539.34 | |
| | | ELME COMMUNITIES | 15,190.00 | 276,609.90 | |
| | | EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 21,276.00 | 225,738.36 | |
| | | EPR PROPERTIES | 12,612.00 | 616,096.20 | |
| | | EQUINIX INC | 17,094.00 | 14,984,087.58 | |
| | | EQUITY COMMONWEALTH | 17,598.00 | 357,415.38 | |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 34,434.00 | 2,593,224.54 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 62,983.00 | 4,898,187.91 | |
| | | ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 32,895.00 | 1,088,166.60 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 11,550.00 | 3,639,982.50 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 38,227.00 | 6,790,262.01 | |
| | | FARMLAND PARTNERS INC | 7,194.00 | 75,608.94 | |
| | | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 13,176.00 | 1,544,490.72 | |
| | | FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 22,908.00 | 1,298,196.36 | |
| | | FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 17,953.00 | 547,207.44 | |
| | | FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 15,115.00 | 25,846.65 | |
| | | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 49,019.00 | 2,531,831.35 | |
| | | GETTY REALTY CORP | 10,369.00 | 337,718.33 | |
| | | GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 5,368.00 | 86,585.84 | |
| | | GLADSTONE LAND CORP | 4,464.00 | 65,129.76 | |
| | | GLOBAL MEDICAL REIT INC | 12,642.00 | 127,304.94 | |
| | | GLOBAL NET LEASE INC | 30,518.00 | 272,220.56 | |
| | | HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 69,152.00 | 1,288,993.28 | |
| | | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 128,507.00 | 2,879,841.87 | |
| | | HIGHWOODS PROPERTIES INC | 19,816.00 | 656,305.92 | |
| | | HOST HOTELS & RESORTS INC | 130,084.00 | 2,271,266.64 | |
| | | HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 17,289.00 | 87,828.12 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 42,537.00 | 897,105.33 | |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 6,274.00 | 31,871.92 | |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 5,313.00 | 705,725.79 | |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 11,866.00 | 353,606.80 | |
| INVITATION HOMES INC | 103,209.00 | 3,794,994.93 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 52,925.00 | 6,255,205.75 | |
| JBG SMITH PROPERTIES | 14,792.00 | 273,504.08 | |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 130,900.00 | 33,379.50 | |
| KILROY REALTY CORP | 19,409.00 | 736,377.46 | |
| KIMCO REALTY CORP | 117,891.00 | 2,836,457.46 | |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 38,279.00 | 1,024,728.83 | |
| LINEAGE INC | 10,282.00 | 849,601.66 | |
| LTC PROPERTIES INC | 7,251.00 | 273,652.74 | |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 52,073.00 | 532,186.06 | |
| MACERICH CO/THE | 38,484.00 | 639,988.92 | |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | 245,900.00 | 26,311.30 | |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 97,588.00 | 619,683.80 | |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 21,016.00 | 3,502,316.40 | |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 13,122.00 | 639,172.62 | |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 7,193.00 | 611,908.51 | |
| NET LEASE OFFICE PROPERTY | 2,275.00 | 68,727.75 | |
| NETSTREIT CORP | 13,768.00 | 233,780.64 | |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES | 7,980.00 | 49,476.00 | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL | 3,529.00 | 164,133.79 | |
| NNN REIT INC | 32,073.00 | 1,564,841.67 | |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRU | 9,538.00 | 21,174.36 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 45,355.00 | 1,850,484.00 | |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 2,352.00 | 67,102.56 | |
| ORION OFFICE REIT INC | 8,094.00 | 33,751.98 | |
| PARAMOUNT GROUP INC | 23,577.00 | 120,006.93 | |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 35,722.00 | 502,965.76 | |
| PEAKSTONE REALTY TRUST | 7,728.00 | 114,219.84 | |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 20,329.00 | 262,040.81 | |
| PHILLIPS EDISON & COMPANY IN | 22,600.00 | 878,462.00 | |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 19,902.00 | 199,617.06 | |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 8,798.00 | 204,113.60 | |
| POSTAL REALTY TRUST INC- A | 1,424.00 | 21,004.00 | |
| PRIME US REIT | 143,770.00 | 27,747.61 | |
| PROLOGIS INC | 167,586.00 | 21,665,518.08 | |
| PUBLIC STORAGE | 28,551.00 | 10,363,727.49 | |
| REALTY INCOME CORP | 158,136.00 | 9,911,964.48 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 30,479.00 | 2,278,914.83 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 22,092.00 | 351,925.56 | |
| | | REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 39,699.00 | 2,033,779.77 | |
| | | RLJ LODGING TRUST | 24,132.00 | 218,153.28 | |
| | | RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 10,529.00 | 1,063,429.00 | |
| | | SABRA HEALTH CARE REIT INC | 44,231.00 | 831,100.49 | |
| | | SAFEHOLD INC | 10,598.00 | 282,118.76 | |
| | | SAUL CENTERS INC | 2,331.00 | 94,895.01 | |
| | | SERVICE PROPERTIES TRUST | 37,820.00 | 169,055.40 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 59,090.00 | 9,743,941.00 | |
| | | SITE CENTERS CORP | 8,123.00 | 491,360.27 | |
| | | SL GREEN REALTY CORP | 11,643.00 | 823,043.67 | |
| | | STAG INDUSTRIAL INC | 32,025.00 | 1,285,483.50 | |
| | | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 14,098.00 | 90,227.20 | |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 22,550.00 | 3,290,270.50 | |
| | | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 39,745.00 | 403,809.20 | |
| | | TANGER INC | 20,789.00 | 660,258.64 | |
| | | TERRENO REALTY CORP | 17,748.00 | 1,234,018.44 | |
| | | UDR INC | 55,893.00 | 2,625,294.21 | |
| | | UMH PROPERTIES INC | 11,316.00 | 228,470.04 | |
| | | UNITI GROUP INC | 46,029.00 | 246,255.15 | |
| | | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 1,344.00 | 61,555.20 | |
| | | URBAN EDGE PROPERTIES | 20,402.00 | 438,643.00 | |
| | | VENTAS INC | 72,232.00 | 4,673,410.40 | |
| | | VERIS RESIDENTIAL INC | 16,966.00 | 305,048.68 | |
| | | VICI PROPERTIES INC | 188,053.00 | 6,401,324.12 | |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 27,687.00 | 1,037,708.76 | |
| | | WELLTOWER INC | 108,411.00 | 14,004,532.98 | |
| | | WHITESTONE REIT | 12,068.00 | 161,228.48 | |
| | | WP CAREY INC | 39,026.00 | 2,496,102.96 | |
| | | XENIA HOTELS & RESORTS INC | 17,827.00 | 246,190.87 | |
| | アメリカ・ドル小計 | | 4,693,467.00 | 222,240,899.98<br>(31,284,851,490) | |
| | カナダ・ドル | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 14,869.00 | 282,362.31 | |
| | | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 9,662.00 | 75,460.22 | |
| | | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 4,788.00 | 433,888.56 | |
| | | BSR REAL ESTATE INVESTMENT T | 3,187.00 | 61,795.93 | |
| | | BTB REAL ESTATE INVESTMENT T | 6,841.00 | 24,217.14 | |
| | | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 14,077.00 | 792,816.64 | |
| | | CHOICE PROPERTIES REIT | 30,541.00 | 463,001.56 | |
| | | CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 10,639.00 | 166,393.96 | |
| | | CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 9,193.00 | 148,007.30 | |
| | | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 23,474.00 | 337,321.38 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 2,732.00 | 59,038.52 | |
| | FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 21,618.00 | 396,690.30 | |
| | GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 5,260.00 | 426,060.00 | |
| | H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 21,001.00 | 237,101.29 | |
| | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 11,198.00 | 144,902.12 | |
| | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 8,107.00 | 173,895.15 | |
| | MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 1,447.00 | 24,381.95 | |
| | MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 1,557.00 | 29,365.02 | |
| | NEXUS INDUSTRIAL REIT | 4,345.00 | 39,105.00 | |
| | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 20,754.00 | 111,656.52 | |
| | PRIMARIS REIT | 6,318.00 | 101,340.72 | |
| | PRO REAL ESTATE INVESTMENT T | 15,604.00 | 92,219.64 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 24,676.00 | 505,117.72 | |
| | SLATE GROCERY REIT-CL U | 3,196.00 | 44,424.40 | |
| | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 12,000.00 | 324,840.00 | |
| | TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 829.00 | 11,158.34 | |
| カナダ・ドル小計 | | 287,913.00 | 5,506,561.69<br>(570,259,529) | |
| オーストラリア・ドル | ABACUS GROUP | 50,980.00 | 66,783.80 | |
| | ABACUS STORAGE KING | 145,482.00 | 189,126.60 | |
| | ARENA REIT | 80,503.00 | 332,477.39 | |
| | BWP TRUST | 115,823.00 | 437,810.94 | |
| | CENTURIA CAPITAL GROUP | 160,667.00 | 306,070.63 | |
| | CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 84,443.00 | 276,128.61 | |
| | CENTURIA OFFICE REIT | 68,559.00 | 84,327.57 | |
| | CHARTER HALL GROUP | 83,440.00 | 1,324,192.80 | |
| | CHARTER HALL LONG WALE REIT | 134,611.00 | 539,790.11 | |
| | CHARTER HALL RETAIL REIT | 91,686.00 | 335,570.76 | |
| | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR | 72,491.00 | 200,800.07 | |
| | CROMWELL PROPERTY GROUP | 218,718.00 | 95,142.33 | |
| | DEXUS INDUSTRIA REIT | 30,237.00 | 87,989.67 | |
| | DEXUS/AU | 190,461.00 | 1,441,789.77 | |
| | GDI PROPERTY GROUP | 83,204.00 | 54,082.60 | |
| | GOODMAN GROUP | 314,107.00 | 11,191,632.41 | |
| | GPT GROUP | 330,937.00 | 1,677,850.59 | |
| | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 52,361.00 | 141,374.70 | |
| | HEALTHCO REIT | 51,410.00 | 60,920.85 | |
| | HMC CAPITAL LTD | 53,344.00 | 431,552.96 | |
| | HOMECO DAILY NEEDS REIT | 332,002.00 | 429,942.59 | |
| | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS | 55,080.00 | 204,897.60 | |
| | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 62,840.00 | 326,768.00 | |
| | MIRVAC GROUP | 701,595.00 | 1,578,588.75 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | NATIONAL STORAGE REIT | 208,817.00 | 507,425.31 | |
| | REGION RE LTD | 191,819.00 | 446,938.27 | |
| | RURAL FUNDS GROUP | 52,739.00 | 106,005.39 | |
| | SCENTRE GROUP | 960,992.00 | 3,555,670.40 | |
| | STOCKLAND | 416,620.00 | 2,195,587.40 | |
| | VICINITY CENTRES | 664,812.00 | 1,549,011.96 | |
| | WAYPOINT REIT | 113,111.00 | 308,793.03 | |
| オーストラリア・ドル小計 | | 6,173,891.00 | 30,485,043.86<br>(2,892,725,812) | |
| 香港・ドル | CHAMPION REIT | 435,000.00 | 804,750.00 | |
| | FORTUNE REIT | 259,000.00 | 1,082,620.00 | |
| | LINK REIT | 449,900.00 | 17,186,180.00 | |
| | PROSPERITY REIT | 312,000.00 | 411,840.00 | |
| | SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST | 202,000.00 | 381,780.00 | |
| | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 494,000.00 | 454,480.00 | |
| 香港・ドル小計 | | 2,151,900.00 | 20,321,650.00<br>(367,008,999) | |
| シンガポール・ドル | AIMS APAC REIT | 113,300.00 | 150,689.00 | |
| | CAPITALAND ASCENDAS REIT | 654,700.00 | 1,924,818.00 | |
| | CAPITALAND ASCOTT TRUST | 428,155.00 | 402,465.70 | |
| | CAPITALAND CHINA TRUST | 205,700.00 | 150,161.00 | |
| | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 956,708.00 | 2,076,056.36 | |
| | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 159,550.00 | 153,168.00 | |
| | EC WORLD REIT | 52,800.00 | 14,784.00 | |
| | ESR-LOGOS REIT | 1,097,413.00 | 312,762.70 | |
| | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 190,000.00 | 122,550.00 | |
| | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 221,100.00 | 528,429.00 | |
| | FRASERS LOGISTICS & COMMERCI | 527,638.00 | 617,336.46 | |
| | KEPPEL DC REIT | 258,900.00 | 579,936.00 | |
| | KEPPEL REIT | 363,300.00 | 346,951.50 | |
| | LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL | 262,000.00 | 162,440.00 | |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 363,300.00 | 926,415.00 | |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 558,250.00 | 803,880.00 | |
| | MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST | 446,000.00 | 660,080.00 | |
| | PARAGON REIT | 215,200.00 | 186,148.00 | |
| | PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 69,800.00 | 286,878.00 | |
| | SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 66,700.00 | 44,689.00 | |
| | STARHILL GLOBAL REIT | 195,000.00 | 102,375.00 | |
| | SUNTEC REIT | 416,400.00 | 545,484.00 | |
| シンガポール・ドル小計 | | 7,821,914.00 | 11,098,496.72<br>(1,205,185,759) | |
| ニュージ | ARGOSY PROPERTY LTD | 153,482.00 | 171,899.84 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ーラン<br>ド・ドル | GOODMAN PROPERTY TRUST | 211,264.00 | 454,217.60 | |
| | KIWI PROPERTY GROUP LTD | 264,918.00 | 247,698.33 | |
| | PRECINCT PROPERTIES GROUP | 269,326.00 | 348,777.17 | |
| ニュージーランド・ドル小計 | | 898,990.00 | 1,222,592.94<br>(106,451,167) | |
| イギリ<br>ス・ポン<br>ド | ABRDN PROPERTY INCOME TRUST | 53,280.00 | 31,168.80 | |
| | AEW UK REIT PLC | 9,000.00 | 8,874.00 | |
| | ASSURA PLC | 472,915.00 | 199,097.21 | |
| | BALANCED COMM PROPERTY TRUST | 154,750.00 | 146,857.75 | |
| | BIG YELLOW GROUP PLC | 35,499.00 | 468,586.80 | |
| | BRITISH LAND CO PLC | 162,562.00 | 751,686.68 | |
| | CLS HOLDINGS PLC | 41,598.00 | 38,103.76 | |
| | CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE | 84,958.00 | 71,534.63 | |
| | DERWENT LONDON PLC | 20,725.00 | 519,783.00 | |
| | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 95,000.00 | 94,050.00 | |
| | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 71,900.00 | 262,794.50 | |
| | HAMMERSON PLC | 740,000.00 | 222,000.00 | |
| | HELICAL PLC | 17,000.00 | 38,675.00 | |
| | HOME REIT PLC | 96,051.00 | 36,499.38 | |
| | IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 88,651.00 | 80,495.10 | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 141,683.00 | 955,651.83 | |
| | LIFE SCIENCE REIT PLC | 104,502.00 | 32,918.13 | |
| | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 367,037.00 | 767,107.33 | |
| | NEWRIVER REIT PLC | 46,021.00 | 36,954.86 | |
| | PICTON PROPERTY INCOME LTD | 153,900.00 | 118,041.30 | |
| | PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 270,348.00 | 274,132.87 | |
| | PRS REIT PLC/THE | 89,207.00 | 86,619.99 | |
| | REGIONAL REIT LTD | 15,921.00 | 21,557.03 | |
| | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 41,662.00 | 383,707.02 | |
| | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 70,698.00 | 37,045.75 | |
| | SEGRO PLC | 239,847.00 | 2,169,176.26 | |
| | SHAFTESBURY CAPITAL PLC | 361,237.00 | 551,970.13 | |
| | SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 187,422.00 | 145,626.89 | |
| | TARGET HEALTHCARE REIT PLC | 113,949.00 | 102,212.25 | |
| | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 34,770.00 | 22,878.66 | |
| | TRITAX BIG BOX REIT PLC | 420,000.00 | 696,780.00 | |
| | UNITE GROUP PLC/THE | 80,812.00 | 795,190.08 | |
| | URBAN LOGISTICS REIT PLC | 76,400.00 | 94,888.80 | |
| | WAREHOUSE REIT PLC | 72,100.00 | 65,034.20 | |
| | WORKSPACE GROUP PLC | 20,210.00 | 131,365.00 | |
| イギリス・ポンド小計 | | 5,051,615.00 | 10,459,064.99<br>(1,943,712,638) | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| イスラエル・シュケル | MENIVIM- THE NEW REIT LTD | 110,000.00 | 187,330.00 | |
| | REIT 1 LTD | 36,017.00 | 508,560.04 | |
| | SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT | 36,242.00 | 254,781.26 | |
| | イスラエル・シュケル小計 | 182,259.00 | 950,671.30<br>(35,696,947) | |
| 韓国・ウォン | D&D PLATFORM REIT CO LTD | 6,350.00 | 23,622,000.00 | |
| | ESR KENDALL SQUARE REIT CO L | 24,000.00 | 123,360,000.00 | |
| | JR REIT XXVII | 36,632.00 | 131,875,200.00 | |
| | KORAMCO LIFE INFRA REIT | 6,226.00 | 29,480,110.00 | |
| | KORAMCO LIFE INFRA RE-RIGHTS | 618.00 | 205,794.00 | |
| | LOTTE REIT CO LTD | 20,121.00 | 77,264,640.00 | |
| | NH ALL-ONE REIT CO LTD | 12,561.00 | 46,601,310.00 | |
| | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 8,762.00 | 51,695,800.00 | |
| | SHINHAN ALPHA REIT CO-RIGHTS | 3,124.00 | 349,888.00 | |
| | SK REITS CO LTD | 27,115.00 | 143,438,350.00 | |
| | 韓国・ウォン小計 | 145,509.00 | 627,893,092.00<br>(66,996,193) | |
| ユーロ | AEDIFICA | 9,212.00 | 592,331.60 | |
| | ALTAREA | 723.00 | 79,530.00 | |
| | CARE PROPERTY INVEST | 5,582.00 | 84,734.76 | |
| | CARMILA | 10,208.00 | 179,864.96 | |
| | COFINIMMO | 6,947.00 | 462,322.85 | |
| | COVIVIO | 8,887.00 | 487,451.95 | |
| | CROMWELL REIT EUR | 48,320.00 | 76,345.60 | |
| | EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 7,912.00 | 200,964.80 | |
| | GECINA SA | 9,405.00 | 1,008,216.00 | |
| | HAMBORNER REIT AG | 12,897.00 | 84,862.26 | |
| | ICADE | 5,968.00 | 157,913.28 | |
| | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 7,889.00 | 20,669.18 | |
| | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 52,295.00 | 336,256.85 | |
| | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 62,588.00 | 56,642.14 | |
| | KLEPIERRE | 34,558.00 | 1,008,402.44 | |
| | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 12,639.00 | 103,639.80 | |
| | MERCIALYS | 15,342.00 | 189,166.86 | |
| | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 71,325.00 | 842,348.25 | |
| | MONTEA NV | 3,238.00 | 255,154.40 | |
| | NSI NV | 2,966.00 | 61,989.40 | |
| | RETAIL ESTATES | 2,065.00 | 139,594.00 | |
| | SHURGARD SELF STORAGE LTD | 5,756.00 | 247,795.80 | |
| | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 18,737.00 | 1,452,117.50 | |
| | VASTNED RETAIL NV | 2,919.00 | 69,910.05 | |
| | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 30,825.00 | 762,610.50 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | WERELDHAVE NV | 6,708.00 | 100,217.52 | |
| | | XIOR STUDENT HOUSING NV | 5,846.00 | 206,656.10 | |
| | ユーロ小計 | | 461,757.00 | 9,267,708.85<br>(1,450,859,819) | |
| 投資証券合計 | | | | 39,923,748,353<br>(39,923,748,353) | |
| 合　計 | | | | 39,923,748,353<br>(39,923,748,353) | |

（注）金額欄の(　)内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 通　貨 | 銘柄数 | | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 投資証券 | 139 銘柄 | 75.0% | 78.4% |
| カナダ・ドル | 投資証券 | 26 銘柄 | 1.4% | 1.4% |
| オーストラリア・ドル | 投資証券 | 31 銘柄 | 6.9% | 7.2% |
| 香港・ドル | 投資証券 | 6 銘柄 | 0.9% | 0.9% |
| シンガポール・ドル | 投資証券 | 22 銘柄 | 2.9% | 3.0% |
| ニュージーランド・ドル | 投資証券 | 4 銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| イギリス・ポンド | 投資証券 | 35 銘柄 | 4.7% | 4.9% |
| イスラエル・シュケル | 投資証券 | 3 銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| 韓国・ウォン | 投資証券 | 10 銘柄 | 0.2% | 0.2% |
| ユーロ | 投資証券 | 27 銘柄 | 3.5% | 3.6% |

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

| | (2024年9月17日現在) |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 金銭信託 | 4,585,240 |
| コール・ローン | 455,881,936 |
| 国債証券 | 107,491,698,990 |
| 地方債証券 | 11,575,813,850 |
| 特殊債券 | 10,141,610,704 |
| 社債券 | 7,733,533,100 |
| 未収入金 | 217,687,500 |
| 未収利息 | 404,056,654 |
| 前払費用 | 26,703,741 |
| 流動資産合計 | 138,051,571,715 |
| 資産合計 | 138,051,571,715 |
| 負債の部 | |

| | |
|---|---|
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 198,289,999 |
| 流動負債合計 | 198,289,999 |
| 負債合計 | 198,289,999 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 114,582,435,445 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 23,270,846,271 |
| 元本等合計 | 137,853,281,716 |
| 純資産合計 | 137,853,281,716 |
| 負債純資産合計 | 138,051,571,715 |

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | (2024年9月17日現在) |
|---|---|
| １．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 114,582,435,445口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　1.2031円<br>（１万口当たりの純資産額12,031円） |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

| 項　目 | 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| 1．　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容<br>1) 有価証券<br>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。<br>2) デリバティブ取引<br>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。<br>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>(2) 金融商品に係るリスク<br>有価証券およびデリバティブ取引等<br>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |
| 3．　金融商品に係るリスク管理体制 | リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。<br>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。<br>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。 |

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | (2024年9月17日現在) |
|---|---|
| １．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| ２．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| ３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| (2024年9月17日現在) | |
|---|---|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 105,659,583,769円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 29,471,236,502円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 20,548,384,826円 |
| | |
| 2024年9月17日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型） | 10,343,539,283円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型） | 16,888,922,140円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型） | 4,452,977,078円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 884,408,392円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ） | 43,596,669円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ） | 168,936,664円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ） | 631,790,723円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ） | 1,290,389,853円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ） | 737,500,143円 |

| | |
|---|---|
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ） | 882,263,784 円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型） | 135,923,163 円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 2,579,085,471 円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 1,128,067,579 円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 432,894,496 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０ | 185,583,392 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 3,838,117,862 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 1,152,749,545 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 2,399,387,825 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 582,772,045 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 90,370,739 円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 395,038,749 円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型） | 459,312,002 円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型） | 1,022,810,205 円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型） | 354,619,551 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０ | 19,874,233 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５ | 264,771,474 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０ | 129,124,993 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５ | 82,730,168 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５ | 16,396,505 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５ | 10,595,273 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 12,241,466 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 114,469,362 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 301,057,687 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 150,851,209 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 13,623,862 円 |
| ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞ | 997,067,571 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 7,349,765,218 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞ | 5,880,259,722 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 15,321,899,551 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞ | 299,682,684 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞ | 492,021,940 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞ | 284,234,196 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞ | 122,911,810 円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 1,771,183,954 円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 2,237,429,887 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞ | 2,074,157,208 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞ | 7,253,535,759 円 |
| 三井住友・国内債券インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用） | 885,421,999 円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 365,526,555 円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 416,257,652 円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 140,691,746 円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 54,178,432 円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 1,053,377,150 円 |

| | |
|---|---|
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 1,912,644,726円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 532,613,671円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 228,840,970円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 26,228,031円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞ | 234,896,115円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞ | 4,481,901,742円 |
| ＳＭＡＭ・年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 1,372,264,667円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞ | 665,197,090円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞ | 1,061,464,793円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞ | 4,256,860,308円 |
| ＳＭＤＡＭ・年金Wリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定＞ | 613,126,713円 |
| 合　計 | 114,582,435,445円 |

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種　類 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| 国債証券 | ４５９　２年国債 | 1,960,000,000 | 1,955,648,800 | |
| | ４６０　２年国債 | 500,000,000 | 499,555,000 | |
| | ４６１　２年国債 | 2,000,000,000 | 2,001,340,000 | |
| | ４６２　２年国債 | 50,000,000 | 50,031,000 | |
| | ４６３　２年国債 | 350,000,000 | 350,161,000 | |
| | １４８　５年国債 | 1,180,000,000 | 1,172,589,600 | |
| | １４９　５年国債 | 1,090,000,000 | 1,082,075,700 | |
| | １５０　５年国債 | 2,590,000,000 | 2,568,554,800 | |
| | １５１　５年国債 | 100,000,000 | 99,070,000 | |
| | １５２　５年国債 | 730,000,000 | 724,933,800 | |
| | １５３　５年国債 | 800,000,000 | 791,712,000 | |
| | １５４　５年国債 | 1,220,000,000 | 1,209,483,600 | |
| | １５６　５年国債 | 1,180,000,000 | 1,172,601,400 | |
| | １５７　５年国債 | 370,000,000 | 367,443,300 | |
| | １５８　５年国債 | 880,000,000 | 870,883,200 | |
| | １５９　５年国債 | 100,000,000 | 98,854,000 | |
| | １６０　５年国債 | 690,000,000 | 684,638,700 | |
| | １６１　５年国債 | 790,000,000 | 786,784,700 | |
| | １６２　５年国債 | 220,000,000 | 218,915,400 | |
| | １６３　５年国債 | 570,000,000 | 569,435,700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | １６４　５年国債 | 240,000,000 | 237,592,800 | |
| | １６５　５年国債 | 820,000,000 | 815,203,000 | |
| | １６６　５年国債 | 440,000,000 | 439,260,800 | |
| | １６７　５年国債 | 140,000,000 | 139,598,200 | |
| | １６８　５年国債 | 710,000,000 | 714,224,500 | |
| | １６９　５年国債 | 670,000,000 | 671,031,800 | |
| | １７０　５年国債 | 610,000,000 | 613,257,400 | |
| | １７１　５年国債 | 390,000,000 | 388,459,500 | |
| | １　４０年国債 | 40,000,000 | 44,440,400 | |
| | ２　４０年国債 | 242,000,000 | 258,017,980 | |
| | ３　４０年国債 | 185,000,000 | 196,048,200 | |
| | ４　４０年国債 | 247,000,000 | 260,288,600 | |
| | ５　４０年国債 | 235,000,000 | 236,466,400 | |
| | ６　４０年国債 | 240,000,000 | 235,214,400 | |
| | ７　４０年国債 | 265,000,000 | 246,813,050 | |
| | ８　４０年国債 | 330,000,000 | 283,103,700 | |
| | ９　４０年国債 | 543,000,000 | 336,410,220 | |
| | １０　４０年国債 | 500,000,000 | 363,055,000 | |
| | １１　４０年国債 | 380,000,000 | 263,180,400 | |
| | １２　４０年国債 | 410,000,000 | 249,772,000 | |
| | １３　４０年国債 | 555,000,000 | 330,974,250 | |
| | １４　４０年国債 | 535,000,000 | 339,227,450 | |
| | １５　４０年国債 | 550,000,000 | 383,999,000 | |
| | １６　４０年国債 | 550,000,000 | 420,106,500 | |
| | １７　４０年国債 | 230,000,000 | 227,355,000 | |
| | ３４３　１０年国債 | 310,000,000 | 308,567,800 | |
| | ３４４　１０年国債 | 811,000,000 | 806,636,820 | |
| | ３４５　１０年国債 | 258,000,000 | 256,413,300 | |
| | ３４６　１０年国債 | 340,000,000 | 337,640,400 | |
| | ３４７　１０年国債 | 100,000,000 | 99,223,000 | |
| | ３４８　１０年国債 | 145,000,000 | 143,750,100 | |
| | ３４９　１０年国債 | 650,000,000 | 643,838,000 | |
| | ３５０　１０年国債 | 510,000,000 | 504,716,400 | |
| | ３５１　１０年国債 | 50,000,000 | 49,427,000 | |
| | ３５２　１０年国債 | 150,000,000 | 148,080,000 | |
| | ３５３　１０年国債 | 180,000,000 | 177,442,200 | |
| | ３５４　１０年国債 | 265,000,000 | 260,733,500 | |
| | ３５５　１０年国債 | 160,000,000 | 157,209,600 | |
| | ３５６　１０年国債 | 530,000,000 | 520,025,400 | |
| | ３５７　１０年国債 | 1,050,000,000 | 1,029,021,000 | |
| | ３５８　１０年国債 | 930,000,000 | 910,563,000 | |
| | ３５９　１０年国債 | 1,130,000,000 | 1,105,027,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ３６０　１０年国債 | 850,000,000 | 830,169,500 | |
| ３６１　１０年国債 | 1,160,000,000 | 1,131,162,400 | |
| ３６２　１０年国債 | 1,180,000,000 | 1,148,470,400 | |
| ３６３　１０年国債 | 1,190,000,000 | 1,155,882,700 | |
| ３６４　１０年国債 | 1,120,000,000 | 1,085,268,800 | |
| ３６５　１０年国債 | 1,160,000,000 | 1,121,232,800 | |
| ３６６　１０年国債 | 1,180,000,000 | 1,146,523,400 | |
| ３６７　１０年国債 | 1,150,000,000 | 1,114,258,000 | |
| ３６８　１０年国債 | 1,110,000,000 | 1,072,393,200 | |
| ３６９　１０年国債 | 1,220,000,000 | 1,204,237,600 | |
| ３７０　１０年国債 | 1,220,000,000 | 1,201,382,800 | |
| ３７１　１０年国債 | 1,240,000,000 | 1,207,313,600 | |
| ３７２　１０年国債 | 1,050,000,000 | 1,055,313,000 | |
| ３７３　１０年国債 | 1,020,000,000 | 1,004,577,600 | |
| ３７４　１０年国債 | 1,000,000,000 | 1,000,000,000 | |
| ３７５　１０年国債 | 1,030,000,000 | 1,055,564,600 | |
| ２　３０年国債 | 440,000,000 | 485,047,200 | |
| ４　３０年国債 | 340,000,000 | 389,558,400 | |
| ５　３０年国債 | 290,000,000 | 321,708,600 | |
| ７　３０年国債 | 474,000,000 | 534,245,400 | |
| ９　３０年国債 | 240,000,000 | 254,200,800 | |
| １０　３０年国債 | 95,000,000 | 98,246,150 | |
| １１　３０年国債 | 430,000,000 | 466,042,600 | |
| １２　３０年国債 | 570,000,000 | 637,328,400 | |
| １４　３０年国債 | 392,000,000 | 449,365,280 | |
| １６　３０年国債 | 205,000,000 | 237,064,050 | |
| １８　３０年国債 | 190,000,000 | 216,142,100 | |
| １９　３０年国債 | 170,000,000 | 193,522,900 | |
| ２１　３０年国債 | 345,000,000 | 392,754,900 | |
| ２２　３０年国債 | 315,000,000 | 365,431,500 | |
| ２３　３０年国債 | 349,000,000 | 405,122,690 | |
| ２４　３０年国債 | 460,000,000 | 533,954,200 | |
| ２５　３０年国債 | 260,000,000 | 295,929,400 | |
| ２６　３０年国債 | 253,000,000 | 290,742,540 | |
| ２７　３０年国債 | 250,000,000 | 290,150,000 | |
| ２８　３０年国債 | 96,000,000 | 111,406,080 | |
| ２９　３０年国債 | 157,000,000 | 179,912,580 | |
| ３０　３０年国債 | 142,000,000 | 160,697,140 | |
| ３１　３０年国債 | 235,000,000 | 262,048,500 | |
| ３２　３０年国債 | 360,000,000 | 405,658,800 | |
| ３３　３０年国債 | 208,000,000 | 225,053,920 | |
| ３４　３０年国債 | 87,000,000 | 96,393,390 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ３５　３０年国債 | 260,000,000 | 279,697,600 | |
| ３６　３０年国債 | 90,000,000 | 96,571,800 | |
| ３７　３０年国債 | 225,000,000 | 237,422,250 | |
| ３８　３０年国債 | 220,000,000 | 227,744,000 | |
| ３９　３０年国債 | 220,000,000 | 230,850,400 | |
| ４０　３０年国債 | 260,000,000 | 267,966,400 | |
| ４１　３０年国債 | 240,000,000 | 243,172,800 | |
| ４２　３０年国債 | 280,000,000 | 283,108,000 | |
| ４３　３０年国債 | 295,000,000 | 297,416,050 | |
| ４４　３０年国債 | 310,000,000 | 312,095,600 | |
| ４５　３０年国債 | 315,000,000 | 305,735,850 | |
| ４６　３０年国債 | 315,000,000 | 304,957,800 | |
| ４７　３０年国債 | 370,000,000 | 363,765,500 | |
| ４８　３０年国債 | 400,000,000 | 378,204,000 | |
| ４９　３０年国債 | 395,000,000 | 372,425,750 | |
| ５０　３０年国債 | 395,000,000 | 328,920,450 | |
| ５１　３０年国債 | 355,000,000 | 262,323,700 | |
| ５２　３０年国債 | 223,000,000 | 172,017,740 | |
| ５３　３０年国債 | 297,000,000 | 233,504,370 | |
| ５４　３０年国債 | 175,000,000 | 143,412,500 | |
| ５５　３０年国債 | 285,000,000 | 232,611,300 | |
| ５６　３０年国債 | 410,000,000 | 333,264,400 | |
| ５７　３０年国債 | 425,000,000 | 344,046,000 | |
| ５８　３０年国債 | 430,000,000 | 346,674,600 | |
| ５９　３０年国債 | 420,000,000 | 329,158,200 | |
| ６０　３０年国債 | 280,000,000 | 229,300,400 | |
| ６１　３０年国債 | 295,000,000 | 228,999,650 | |
| ６２　３０年国債 | 275,000,000 | 201,536,500 | |
| ６３　３０年国債 | 230,000,000 | 163,127,500 | |
| ６４　３０年国債 | 315,000,000 | 222,100,200 | |
| ６５　３０年国債 | 295,000,000 | 206,945,450 | |
| ６６　３０年国債 | 360,000,000 | 251,064,000 | |
| ６７　３０年国債 | 410,000,000 | 300,919,500 | |
| ６８　３０年国債 | 340,000,000 | 248,370,000 | |
| ６９　３０年国債 | 460,000,000 | 343,735,000 | |
| ７０　３０年国債 | 370,000,000 | 275,243,000 | |
| ７１　３０年国債 | 390,000,000 | 288,802,800 | |
| ７２　３０年国債 | 400,000,000 | 294,856,000 | |
| ７３　３０年国債 | 410,000,000 | 300,853,900 | |
| ７４　３０年国債 | 380,000,000 | 301,864,400 | |
| ７５　３０年国債 | 330,000,000 | 282,470,100 | |
| ７６　３０年国債 | 390,000,000 | 341,554,200 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ７７　３０年国債 | 360,000,000 | 330,127,200 | |
| ７８　３０年国債 | 390,000,000 | 339,807,000 | |
| ７９　３０年国債 | 390,000,000 | 322,159,500 | |
| ８０　３０年国債 | 360,000,000 | 343,940,400 | |
| ８１　３０年国債 | 340,000,000 | 309,471,400 | |
| ８２　３０年国債 | 380,000,000 | 362,200,800 | |
| ８３　３０年国債 | 280,000,000 | 291,533,200 | |
| ８８　２０年国債 | 742,000,000 | 767,079,600 | |
| ８９　２０年国債 | 20,000,000 | 20,641,200 | |
| ９０　２０年国債 | 580,000,000 | 601,187,400 | |
| ９２　２０年国債 | 324,000,000 | 336,532,320 | |
| ９３　２０年国債 | 632,000,000 | 657,444,320 | |
| ９５　２０年国債 | 305,000,000 | 321,000,300 | |
| ９７　２０年国債 | 327,000,000 | 344,684,160 | |
| ９９　２０年国債 | 153,000,000 | 161,433,360 | |
| １００　２０年国債 | 207,000,000 | 219,941,640 | |
| １０１　２０年国債 | 355,000,000 | 379,644,100 | |
| １０２　２０年国債 | 457,000,000 | 490,886,550 | |
| １０５　２０年国債 | 370,000,000 | 394,638,300 | |
| １０６　２０年国債 | 370,000,000 | 396,096,100 | |
| １０７　２０年国債 | 378,000,000 | 404,460,000 | |
| １０９　２０年国債 | 40,000,000 | 42,549,200 | |
| １１１　２０年国債 | 386,000,000 | 417,045,980 | |
| １１３　２０年国債 | 27,000,000 | 29,159,190 | |
| １１４　２０年国債 | 163,000,000 | 176,623,540 | |
| １１８　２０年国債 | 200,000,000 | 217,140,000 | |
| １１９　２０年国債 | 295,000,000 | 316,889,000 | |
| １２０　２０年国債 | 200,000,000 | 212,600,000 | |
| １２１　２０年国債 | 55,000,000 | 59,558,400 | |
| １２２　２０年国債 | 130,000,000 | 140,016,500 | |
| １２３　２０年国債 | 70,000,000 | 76,862,800 | |
| １２５　２０年国債 | 205,000,000 | 227,014,950 | |
| １２６　２０年国債 | 180,000,000 | 197,001,000 | |
| １２７　２０年国債 | 145,000,000 | 157,781,750 | |
| １２８　２０年国債 | 65,000,000 | 70,898,100 | |
| １３０　２０年国債 | 155,000,000 | 168,295,900 | |
| １３１　２０年国債 | 80,000,000 | 86,321,600 | |
| １３２　２０年国債 | 450,000,000 | 486,099,000 | |
| １３３　２０年国債 | 190,000,000 | 206,568,000 | |
| １３４　２０年国債 | 200,000,000 | 217,774,000 | |
| １３５　２０年国債 | 155,000,000 | 167,658,850 | |
| １３６　２０年国債 | 120,000,000 | 128,890,800 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| １３７　２０年国債 | 185,000,000 | 200,223,650 | |
| １３９　２０年国債 | 60,000,000 | 64,468,800 | |
| １４０　２０年国債 | 420,000,000 | 454,939,800 | |
| １４１　２０年国債 | 360,000,000 | 389,919,600 | |
| １４２　２０年国債 | 240,000,000 | 261,928,800 | |
| １４３　２０年国債 | 150,000,000 | 161,349,000 | |
| １４４　２０年国債 | 170,000,000 | 181,420,600 | |
| １４５　２０年国債 | 110,000,000 | 119,220,200 | |
| １４６　２０年国債 | 195,000,000 | 211,249,350 | |
| １４７　２０年国債 | 840,000,000 | 902,176,800 | |
| １４８　２０年国債 | 459,000,000 | 488,449,440 | |
| １４９　２０年国債 | 625,000,000 | 663,981,250 | |
| １５０　２０年国債 | 691,000,000 | 726,379,200 | |
| １５１　２０年国債 | 680,000,000 | 700,461,200 | |
| １５２　２０年国債 | 640,000,000 | 657,785,600 | |
| １５３　２０年国債 | 587,000,000 | 608,231,790 | |
| １５４　２０年国債 | 600,000,000 | 614,328,000 | |
| １５５　２０年国債 | 450,000,000 | 450,225,000 | |
| １５６　２０年国債 | 400,000,000 | 373,124,000 | |
| １５７　２０年国債 | 445,000,000 | 403,526,000 | |
| １５８　２０年国債 | 430,000,000 | 402,424,100 | |
| １５９　２０年国債 | 508,000,000 | 479,272,600 | |
| １６０　２０年国債 | 445,000,000 | 423,341,850 | |
| １６１　２０年国債 | 480,000,000 | 449,136,000 | |
| １６２　２０年国債 | 620,000,000 | 577,821,400 | |
| １６３　２０年国債 | 620,000,000 | 575,484,000 | |
| １６４　２０年国債 | 535,000,000 | 487,802,300 | |
| １６５　２０年国債 | 600,000,000 | 544,314,000 | |
| １６６　２０年国債 | 545,000,000 | 505,956,200 | |
| １６７　２０年国債 | 530,000,000 | 476,141,400 | |
| １６８　２０年国債 | 520,000,000 | 458,146,000 | |
| １６９　２０年国債 | 570,000,000 | 491,824,500 | |
| １７０　２０年国債 | 1,015,000,000 | 870,606,100 | |
| １７１　２０年国債 | 505,000,000 | 430,835,700 | |
| １７２　２０年国債 | 500,000,000 | 431,365,000 | |
| １７３　２０年国債 | 515,000,000 | 441,967,850 | |
| １７４　２０年国債 | 690,000,000 | 588,990,900 | |
| １７５　２０年国債 | 705,000,000 | 608,887,350 | |
| １７６　２０年国債 | 750,000,000 | 644,400,000 | |
| １７７　２０年国債 | 740,000,000 | 621,851,600 | |
| １７８　２０年国債 | 630,000,000 | 536,281,200 | |
| １７９　２０年国債 | 550,000,000 | 465,987,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | １８０　２０年国債 | 540,000,000 | 480,276,000 | |
| | １８１　２０年国債 | 590,000,000 | 531,790,600 | |
| | １８２　２０年国債 | 660,000,000 | 613,437,000 | |
| | １８３　２０年国債 | 590,000,000 | 574,542,000 | |
| | １８４　２０年国債 | 570,000,000 | 526,303,800 | |
| | １８５　２０年国債 | 600,000,000 | 551,946,000 | |
| | １８６　２０年国債 | 480,000,000 | 471,283,200 | |
| | １８７　２０年国債 | 450,000,000 | 426,051,000 | |
| | １８８　２０年国債 | 450,000,000 | 447,336,000 | |
| | １８９　２０年国債 | 440,000,000 | 458,436,000 | |
| | 国債証券　小計 | | 107,491,698,990 | |
| 地方債証券 | ７５５　東京都公債 | 400,000,000 | 397,738,800 | |
| | １　東京都３０年 | 100,000,000 | 111,849,100 | |
| | ８　東京都３０年 | 400,000,000 | 443,640,400 | |
| | １３　東京都３０年 | 500,000,000 | 523,275,000 | |
| | ６　東京都２０年 | 100,000,000 | 100,871,200 | |
| | ２６－１５　北海道公債 | 100,000,000 | 100,078,500 | |
| | ３０－８　北海道公債 | 200,000,000 | 197,862,800 | |
| | ３０－１８　北海道公債 | 200,000,000 | 196,397,000 | |
| | ２２６　神奈川県公債 | 200,000,000 | 198,659,800 | |
| | ３　神奈川県２０年 | 100,000,000 | 101,368,600 | |
| | ７　神奈川県２０年 | 100,000,000 | 104,357,400 | |
| | １３　神奈川県２０年 | 100,000,000 | 108,448,900 | |
| | ８９　神奈川県５年 | 200,000,000 | 198,190,800 | |
| | ３９２　大阪府公債 | 100,000,000 | 100,038,800 | |
| | １　大阪府２０年 | 200,000,000 | 215,914,400 | |
| | １７３　大阪府５年 | 300,000,000 | 299,196,900 | |
| | １７９　大阪府５年 | 100,000,000 | 99,435,600 | |
| | １９３　大阪府５年 | 300,000,000 | 296,494,800 | |
| | ２７－４　京都府公債 | 100,000,000 | 100,195,300 | |
| | ２９－４　京都府公債 | 100,000,000 | 99,231,900 | |
| | ４　兵庫県公債１５年 | 100,000,000 | 102,677,500 | |
| | ５　兵庫県公債１５年 | 300,000,000 | 308,854,500 | |
| | １０兵庫県公債２０年 | 100,000,000 | 108,863,400 | |
| | ２７－８　静岡県公債 | 100,000,000 | 100,139,200 | |
| | ７　静岡県３０年 | 100,000,000 | 104,855,700 | |
| | １　静岡県２０年 | 100,000,000 | 101,840,700 | |
| | ２２－８　愛知県２０年 | 200,000,000 | 215,363,000 | |
| | ２７－１６　愛知県公債 | 400,000,000 | 400,278,000 | |
| | ２７－７　埼玉県公債 | 300,000,000 | 300,269,400 | |
| | ２　埼玉県公債 | 300,000,000 | 297,792,900 | |
| | ５　埼玉県２０年 | 100,000,000 | 106,447,700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | ２６－１０　福岡県公債 | 100,000,000 | 100,088,200 | |
| | １－１　福岡県公債 | 200,000,000 | 194,950,600 | |
| | １－３　福岡県３０年 | 100,000,000 | 69,572,000 | |
| | ２７－３　千葉県公債 | 100,000,000 | 100,175,800 | |
| | ２７－４　千葉県公債 | 100,000,000 | 100,245,500 | |
| | ２８－１　千葉県公債 | 100,000,000 | 99,398,300 | |
| | １－９　千葉県公債 | 200,000,000 | 194,301,200 | |
| | ９　千葉県２０年 | 200,000,000 | 214,904,600 | |
| | １４８　共同発行地方 | 350,000,000 | 350,722,750 | |
| | １５５　共同発行地方 | 100,000,000 | 99,703,500 | |
| | １７０　共同発行地方 | 400,000,000 | 396,924,000 | |
| | １７２　共同発行地方 | 500,000,000 | 496,517,000 | |
| | １７９　共同発行地方 | 100,000,000 | 99,157,300 | |
| | １８３　共同発行地方 | 600,000,000 | 593,407,200 | |
| | １８４　共同発行地方 | 300,000,000 | 296,181,900 | |
| | １９９　共同発行地方 | 100,000,000 | 97,367,700 | |
| | ４９４　名古屋市債 | 200,000,000 | 200,160,000 | |
| | ３３　名古屋市５年 | 300,000,000 | 300,231,600 | |
| | ３　名古屋市２０年 | 100,000,000 | 101,309,000 | |
| | ５　名古屋市２０年 | 100,000,000 | 103,672,300 | |
| | １　京都市３０年 | 100,000,000 | 115,450,900 | |
| | ７　京都市２０年 | 100,000,000 | 107,363,200 | |
| | ２６－１７　神戸市公債 | 100,000,000 | 100,009,700 | |
| | ４　横浜市２０年 | 100,000,000 | 100,881,200 | |
| | ７　横浜市２０年 | 100,000,000 | 102,082,800 | |
| | ９　横浜市２０年 | 100,000,000 | 103,326,400 | |
| | １４　横浜市２０年 | 100,000,000 | 106,337,200 | |
| | ２７－５　札幌市公債 | 100,000,000 | 100,129,200 | |
| | ２－７　札幌市公債 | 100,000,000 | 97,057,300 | |
| | ９４　川崎市公債 | 100,000,000 | 96,354,700 | |
| | ２０２０－９　福岡市５年 | 100,000,000 | 99,505,400 | |
| | １－２　岡山県公債 | 100,000,000 | 97,697,400 | |
| | 地方債証券　小計 | | 11,575,813,850 | |
| 特殊債券 | ４７日本政策投資ＣＯ | 100,000,000 | 101,848,300 | |
| | １２４　日本政策投資 | 100,000,000 | 97,241,200 | |
| | ３６　日本政策投資Ｂ | 100,000,000 | 104,491,700 | |
| | １８　道路機構 | 100,000,000 | 116,264,300 | |
| | ２２　道路機構 | 300,000,000 | 337,638,600 | |
| | ２７　道路機構 | 100,000,000 | 105,455,400 | |
| | ３７　道路機構 | 300,000,000 | 320,492,100 | |
| | ４７　道路機構 | 200,000,000 | 215,983,800 | |
| | １３５　道路機構 | 200,000,000 | 202,732,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | ７４　政保道路機構 | 100,000,000 | 105,955,200 | |
| | ７９　政保道路機構 | 200,000,000 | 214,173,000 | |
| | ８１　政保道路機構 | 200,000,000 | 214,432,800 | |
| | ８８　政保道路機構 | 100,000,000 | 111,858,600 | |
| | ９０　政保道路機構 | 500,000,000 | 538,355,500 | |
| | ９９　政保道路機構 | 100,000,000 | 108,689,700 | |
| | １２７　政保道路機構 | 200,000,000 | 217,693,800 | |
| | １７６　政保道路機構 | 100,000,000 | 107,198,900 | |
| | １９６　政保道路機構 | 100,000,000 | 108,319,300 | |
| | ２１０　政保道路機構 | 200,000,000 | 212,193,400 | |
| | ２８８　政保道路機構 | 189,000,000 | 187,367,796 | |
| | ９　道路債券 | 100,000,000 | 115,718,400 | |
| | ２　地方公営２０年 | 100,000,000 | 107,525,300 | |
| | ４　地方公共団２０年 | 100,000,000 | 107,635,100 | |
| | １８　地方公共団２０ | 300,000,000 | 321,744,600 | |
| | Ｆ９６　地方公共団体 | 100,000,000 | 102,384,700 | |
| | Ｆ１４３地方公共団体 | 100,000,000 | 102,353,500 | |
| | ７６政保地方公共団 | 300,000,000 | 300,356,700 | |
| | ８５　地方公共団体 | 100,000,000 | 99,239,900 | |
| | １０１　地方公共団体 | 100,000,000 | 99,036,100 | |
| | １０６　地方公共団体 | 200,000,000 | 197,600,400 | |
| | ２９　地方公共団５年 | 300,000,000 | 297,168,600 | |
| | １５　公営企業２０年 | 100,000,000 | 101,761,300 | |
| | １７　公営企業２０年 | 100,000,000 | 102,841,600 | |
| | ２０　公営企業２０年 | 100,000,000 | 104,279,300 | |
| | ２２　公営企業２０年 | 100,000,000 | 104,850,100 | |
| | ２４　公営企業２０年 | 200,000,000 | 212,301,400 | |
| | １０　日本政策金融 | 100,000,000 | 108,143,600 | |
| | ８９　都市再生 | 100,000,000 | 102,059,400 | |
| | ９３　都市再生 | 100,000,000 | 102,123,000 | |
| | １１７　都市再生 | 100,000,000 | 100,758,700 | |
| | ３３　政保中部空港 | 200,000,000 | 198,555,400 | |
| | ２３９　政保預金保険 | 600,000,000 | 598,933,800 | |
| | ５２　住宅支援機構 | 100,000,000 | 107,672,200 | |
| | ９３　住宅支援機構 | 100,000,000 | 102,283,300 | |
| | １２４　住宅支援機構 | 100,000,000 | 102,796,600 | |
| | １３０　住宅支援機構 | 200,000,000 | 214,536,200 | |
| | ２２６　住宅支援機構 | 100,000,000 | 98,966,700 | |
| | Ｓ１１　住宅機構ＲＭＢＳ | 9,994,000 | 10,001,995 | |
| | １９　住宅機構ＲＭＢＳ | 12,247,000 | 12,565,422 | |
| | ２４　住宅機構ＲＭＢＳ | 24,418,000 | 25,043,100 | |
| | ２６　住宅機構ＲＭＢＳ | 38,139,000 | 39,184,008 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | ２７　住宅機構ＲＭＢＳ | 13,724,000 | 14,145,326 | |
| | ２８　住宅機構ＲＭＢＳ | 16,038,000 | 16,685,935 | |
| | ２９　住宅機構ＲＭＢＳ | 17,319,000 | 18,048,129 | |
| | ３０　住宅機構ＲＭＢＳ | 16,888,000 | 17,595,607 | |
| | ３２　住宅機構ＲＭＢＳ | 33,390,000 | 34,565,328 | |
| | ３５　住宅機構ＲＭＢＳ | 17,074,000 | 17,736,471 | |
| | ３６　住宅機構ＲＭＢＳ | 16,102,000 | 16,659,129 | |
| | ４３　住宅機構ＲＭＢＳ | 20,972,000 | 21,641,006 | |
| | ４６　住宅機構ＲＭＢＳ | 16,227,000 | 16,780,340 | |
| | ４８　住宅機構ＲＭＢＳ | 30,780,000 | 31,786,506 | |
| | ４９　住宅機構ＲＭＢＳ | 15,755,000 | 16,232,376 | |
| | ５１　住宅機構ＲＭＢＳ | 34,412,000 | 35,440,918 | |
| | ５５　住宅機構ＲＭＢＳ | 46,052,000 | 47,175,668 | |
| | ５７　住宅機構ＲＭＢＳ | 22,041,000 | 22,609,657 | |
| | ５８　住宅機構ＲＭＢＳ | 24,597,000 | 25,209,465 | |
| | ５９　住宅機構ＲＭＢＳ | 46,784,000 | 48,028,454 | |
| | ６０　住宅機構ＲＭＢＳ | 70,830,000 | 72,409,509 | |
| | ６１　住宅機構ＲＭＢＳ | 23,971,000 | 24,421,654 | |
| | ６７　住宅機構ＲＭＢＳ | 30,814,000 | 31,038,942 | |
| | ６９　住宅機構ＲＭＢＳ | 64,550,000 | 65,621,530 | |
| | ７０　住宅機構ＲＭＢＳ | 55,884,000 | 56,884,323 | |
| | ７３　住宅機構ＲＭＢＳ | 31,674,000 | 32,253,634 | |
| | ９９　住宅機構ＲＭＢＳ | 50,295,000 | 49,646,194 | |
| | １２３　住宅機構ＲＭＢＳ | 67,494,000 | 64,146,297 | |
| | １２４　住宅機構ＲＭＢＳ | 66,891,000 | 63,379,222 | |
| | １２５　住宅機構ＲＭＢＳ | 66,799,000 | 63,298,732 | |
| | １２７　住宅機構ＲＭＢＳ | 69,078,000 | 65,223,447 | |
| | １２８　住宅機構ＲＭＢＳ | 67,542,000 | 63,935,257 | |
| | １２９　住宅機構ＲＭＢＳ | 69,469,000 | 65,842,718 | |
| | １３７　住宅機構ＲＭＢＳ | 71,576,000 | 67,660,792 | |
| | １６７　住宅機構ＲＭＢＳ | 83,537,000 | 77,823,069 | |
| | １８３　住宅機構ＲＭＢＳ | 179,846,000 | 169,936,485 | |
| | １８６　住宅機構ＲＭＢＳ | 91,710,000 | 88,215,849 | |
| | １９８　住宅機構ＲＭＢＳ | 191,656,000 | 191,981,814 | |
| | ８５　中日本高速道 | 300,000,000 | 298,745,100 | |
| | 特殊債券　小計 | | 10,141,610,704 | |
| 社債券 | ８６　東日本高速道 | 200,000,000 | 197,717,800 | |
| | １１４　東日本高速道 | 100,000,000 | 100,389,900 | |
| | １０７　中日本高速道 | 200,000,000 | 200,676,400 | |
| | ８４　西日本高速道 | 200,000,000 | 198,877,200 | |
| | ８７　西日本高速道 | 200,000,000 | 200,417,400 | |
| | １３　大和ハウス | 100,000,000 | 98,982,700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | １７　アサヒグループＨＤ | 200,000,000 | 198,023,400 | |
| | ３０　東レ | 100,000,000 | 99,112,600 | |
| | １２　旭化成 | 200,000,000 | 194,174,000 | |
| | ２４三菱ケミカルホールデイ | 100,000,000 | 98,818,000 | |
| | ２１富士フイルムホールデイ | 100,000,000 | 100,107,000 | |
| | ３２　住友電工 | 100,000,000 | 98,440,800 | |
| | １６　小松製作所 | 100,000,000 | 98,512,200 | |
| | ２２　日立製作所 | 100,000,000 | 100,071,000 | |
| | ９　ＴＤＫ | 100,000,000 | 97,520,800 | |
| | ６３　三井物産 | 100,000,000 | 104,390,400 | |
| | ８　みずほコーポレート | 100,000,000 | 105,340,600 | |
| | ８　住友信託　劣後 | 100,000,000 | 104,071,000 | |
| | ９　みずほ銀行劣後 | 100,000,000 | 104,229,300 | |
| | １７　ＮＴＴフアイナンス | 200,000,000 | 197,393,800 | |
| | １８　ＮＴＴフアイナンス | 200,000,000 | 194,204,800 | |
| | ７３　ホンダファイナンス | 200,000,000 | 197,637,400 | |
| | １０１　トヨタファイナンス | 200,000,000 | 199,148,800 | |
| | ２０７　オリツクス | 200,000,000 | 198,185,600 | |
| | ２　三菱ＨＣキヤピタル | 200,000,000 | 197,660,200 | |
| | ５８　三菱地所 | 100,000,000 | 113,817,400 | |
| | １３５　三菱地所 | 200,000,000 | 191,105,200 | |
| | １０　東急 | 100,000,000 | 94,854,300 | |
| | ３８　京王電鉄 | 100,000,000 | 98,837,500 | |
| | １１０東日本旅客鉄 | 100,000,000 | 95,219,900 | |
| | １６９　東日本旅客鉄 | 200,000,000 | 191,187,400 | |
| | ２６　西日本旅客鉄 | 100,000,000 | 108,035,600 | |
| | ６０　西日本旅客鉄 | 200,000,000 | 194,305,200 | |
| | ４１　東海旅客鉄道 | 100,000,000 | 106,090,900 | |
| | ４２　東海旅客鉄道 | 100,000,000 | 106,974,100 | |
| | ４５　東京地下鉄 | 200,000,000 | 193,487,000 | |
| | ６４　阪急阪神ＨＬＤＧ | 100,000,000 | 98,848,000 | |
| | １５　九州旅客鉄道 | 200,000,000 | 198,443,600 | |
| | ３１　ＫＤＤＩ | 200,000,000 | 198,410,800 | |
| | ５４６　中部電力 | 200,000,000 | 191,442,400 | |
| | ５５３　中部電力 | 200,000,000 | 198,339,600 | |
| | ５５０　関西電力 | 300,000,000 | 297,933,600 | |
| | ５６０　関西電力 | 200,000,000 | 201,724,200 | |
| | ５０８　東北電力 | 200,000,000 | 197,121,800 | |
| | ５４７　東北電力 | 100,000,000 | 98,630,700 | |
| | ４９６　九州電力 | 300,000,000 | 285,753,600 | |
| | ５６　東京電力ＰＧ | 200,000,000 | 200,540,800 | |
| | ６６　東京電力ＰＧ | 100,000,000 | 97,530,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | ４１　大阪瓦斯 | 200,000,000 | 191,893,600 | |
| | ７　フアーストリテイリング | 100,000,000 | 98,902,300 | |
| | 社債券　小計 | | 7,733,533,100 | |
| 合　計 | | | 136,942,656,644 | |

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

| | （2024年9月17日現在） |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 246,807,464 |
| 金銭信託 | 11,830,239 |
| コール・ローン | 1,176,207,159 |
| 国債証券 | 176,657,238,753 |
| 未収利息 | 1,324,496,618 |
| 前払費用 | 108,052,760 |
| 流動資産合計 | 179,524,632,993 |
| 資産合計 | 179,524,632,993 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 79,722,933 |
| 流動負債合計 | 79,722,933 |
| 負債合計 | 79,722,933 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 80,572,354,466 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 98,872,555,594 |
| 元本等合計 | 179,444,910,060 |
| 純資産合計 | 179,444,910,060 |
| 負債純資産合計 | 179,524,632,993 |

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br><br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 |

| | |
|---|---|
| | 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| 3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第 60 条および第 61 条に基づいて処理しております。 |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | （2024 年 9 月 17 日現在） |
|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 80,572,354,466 口 |
| 2. １単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　2.2271 円<br>（１万口当たりの純資産額 22,271 円） |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

| 項　目 | 自 2023 年 9 月 16 日<br>至 2024 年 9 月 17 日 |
|---|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容<br>1) 有価証券<br>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。<br>2) デリバティブ取引<br>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。<br>当計算期間については、為替予約取引を行っております。 |

| | |
|---|---|
| | 3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>(2) 金融商品に係るリスク<br>有価証券およびデリバティブ取引等<br>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |
| 3．　金融商品に係るリスク管理体制 | リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。<br>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。<br>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。 |

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | (2024年9月17日現在) |
|---|---|
| 1．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（国債証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ |

| | |
|---|---|
| | 取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|---|
| 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| (2024年9月17日現在) | |
|---|---|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 79,403,960,652円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 13,863,647,209円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 12,695,253,395円 |
| | |
| 2024年9月17日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・ＤＣ外国債券インデックスファンドＳ | 28,332,788,368円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型） | 1,002,073,370円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型） | 2,523,871,866円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型） | 1,532,824,942円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 118,967,029円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ） | 5,567,516円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ） | 21,970,186円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ） | 80,585,426円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ） | 252,816,462円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ） | 211,076,276円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ） | 353,704,343円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型） | 19,521,498円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 38,612,613円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 64,743,524円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 40,503,731円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０ | 52,122,910円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 394,400,984円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 272,850,257円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 800,274,081円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 261,559,099円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 143,088,978円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 277,027,246円 |
| 三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド | 1,357,837,734円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型） | 44,539,158円 |

| | |
|---|---|
| 三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型） | 151,428,714 円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型） | 121,439,101 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０ | 7,187,541 円 |
| 日興ＦＷＳ・先進国債インデックス（為替ヘッジなし） | 4,463,559,766 円 |
| 三井住友ＤＳ・先進国債インデックス・ファンド | 329,834,076 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５ | 14,950,436 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０ | 9,480,528 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５ | 10,584,382 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５ | 6,029,387 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５ | 3,874,367 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 1,120,762 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 3,819,119 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 18,685,645 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 18,586,871 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 7,167,837 円 |
| ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞ | 5,458,669,632 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞ | 18,176,913 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 3,451,385,598 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞ | 3,386,540,500 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 8,181,059,523 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞ | 25,374,037 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞ | 64,513,915 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞ | 652,639,659 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞ | 94,448,421 円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 787,304,796 円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 1,169,912,566 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞ | 1,107,177,726 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞ | 3,286,663,120 円 |
| ＳＭＡＭ・外国債券パッシブファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 5,703,664,886 円 |
| 三井住友・外国債券インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用） | 267,494,495 円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 95,826,153 円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 50,442,563 円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 22,317,166 円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 11,781,731 円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 56,501,585 円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 304,304,665 円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 60,667,510 円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 35,582,152 円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 5,723,530 円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞ | 692,755,925 円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 445,487,788 円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 580,475,822 円 |
| ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 219,399,292 円 |
| ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞ | 195,107,235 円 |

| | |
|---|---|
| ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 149,601,796円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞ | 90,241,775円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞ | 143,958,855円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞ | 149,555,150円 |
| ＳＭＤＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定＞ | 236,521,857円 |
| 合　計 | 80,572,354,466円 |

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 国債証券 | アメリカ・ドル | T 0.25 09/30/25 | 2,000,000.00 | 1,925,500.00 | |
| | | T 0.25 10/31/25 | 1,000,000.00 | 960,390.00 | |
| | | T 0.375 01/31/26 | 2,500,000.00 | 2,387,775.00 | |
| | | T 0.375 07/31/27 | 900,000.00 | 825,165.00 | |
| | | T 0.375 09/30/27 | 1,000,000.00 | 912,650.00 | |
| | | T 0.375 11/30/25 | 2,000,000.00 | 1,919,020.00 | |
| | | T 0.375 12/31/25 | 3,000,000.00 | 2,872,500.00 | |
| | | T 0.5 04/30/27 | 1,200,000.00 | 1,111,776.00 | |
| | | T 0.5 05/31/27 | 2,500,000.00 | 2,310,775.00 | |
| | | T 0.5 06/30/27 | 2,600,000.00 | 2,397,876.00 | |
| | | T 0.5 10/31/27 | 1,000,000.00 | 913,670.00 | |
| | | T 0.625 03/31/27 | 2,400,000.00 | 2,235,456.00 | |
| | | T 0.625 05/15/30 | 5,000,000.00 | 4,278,300.00 | |
| | | T 0.625 07/31/26 | 800,000.00 | 757,560.00 | |
| | | T 0.625 08/15/30 | 4,800,000.00 | 4,076,880.00 | |
| | | T 0.625 11/30/27 | 3,400,000.00 | 3,113,108.00 | |
| | | T 0.625 12/31/27 | 5,600,000.00 | 5,116,104.00 | |
| | | T 0.75 01/31/28 | 5,900,000.00 | 5,400,801.00 | |
| | | T 0.75 04/30/26 | 1,500,000.00 | 1,431,900.00 | |
| | | T 0.75 05/31/26 | 2,000,000.00 | 1,905,380.00 | |
| | | T 0.75 08/31/26 | 1,500,000.00 | 1,421,160.00 | |
| | | T 0.875 06/30/26 | 2,000,000.00 | 1,906,360.00 | |
| | | T 0.875 09/30/26 | 2,500,000.00 | 2,370,650.00 | |
| | | T 0.875 11/15/30 | 4,900,000.00 | 4,201,897.00 | |
| | | T 1 07/31/28 | 2,900,000.00 | 2,646,743.00 | |
| | | T 1.125 02/15/31 | 5,700,000.00 | 4,943,838.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 1.125 02/28/27 | 2,000,000.00 | 1,890,220.00 | |
| | | T 1.125 05/15/40 | 1,650,000.00 | 1,118,188.50 | |
| | | T 1.125 08/15/40 | 3,100,000.00 | 2,082,301.00 | |
| | | T 1.125 08/31/28 | 3,500,000.00 | 3,204,740.00 | |
| | | T 1.125 10/31/26 | 3,700,000.00 | 3,519,181.00 | |
| | | T 1.25 05/15/50 | 3,100,000.00 | 1,728,467.00 | |
| | | T 1.25 05/31/28 | 3,000,000.00 | 2,774,460.00 | |
| | | T 1.25 06/30/28 | 3,000,000.00 | 2,769,990.00 | |
| | | T 1.25 08/15/31 | 5,200,000.00 | 4,483,752.00 | |
| | | T 1.25 09/30/28 | 3,000,000.00 | 2,755,170.00 | |
| | | T 1.25 11/30/26 | 4,200,000.00 | 4,000,332.00 | |
| | | T 1.25 12/31/26 | 2,600,000.00 | 2,473,380.00 | |
| | | T 1.375 08/15/50 | 4,500,000.00 | 2,582,190.00 | |
| | | T 1.375 08/31/26 | 600,000.00 | 575,526.00 | |
| | | T 1.375 10/31/28 | 3,000,000.00 | 2,765,010.00 | |
| | | T 1.375 11/15/31 | 4,900,000.00 | 4,239,137.00 | |
| | | T 1.375 11/15/40 | 3,500,000.00 | 2,433,025.00 | |
| | | T 1.375 12/31/28 | 1,000,000.00 | 919,120.00 | |
| | | T 1.5 01/31/27 | 3,400,000.00 | 3,247,238.00 | |
| | | T 1.5 02/15/30 | 2,100,000.00 | 1,899,513.00 | |
| | | T 1.5 11/30/28 | 4,500,000.00 | 4,162,905.00 | |
| | | T 1.625 02/15/26 | 2,900,000.00 | 2,816,277.00 | |
| | | T 1.625 05/15/26 | 11,450,000.00 | 11,078,905.50 | |
| | | T 1.625 05/15/31 | 5,500,000.00 | 4,892,415.00 | |
| | | T 1.625 08/15/29 | 3,750,000.00 | 3,450,712.50 | |
| | | T 1.625 09/30/26 | 900,000.00 | 866,421.00 | |
| | | T 1.625 11/15/50 | 3,200,000.00 | 1,957,408.00 | |
| | | T 1.625 11/30/26 | 200,000.00 | 192,014.00 | |
| | | T 1.75 01/31/29 | 3,300,000.00 | 3,076,656.00 | |
| | | T 1.75 08/15/41 | 3,400,000.00 | 2,469,046.00 | |
| | | T 1.75 11/15/29 | 1,300,000.00 | 1,198,028.00 | |
| | | T 1.75 12/31/26 | 2,500,000.00 | 2,405,025.00 | |
| | | T 1.875 02/15/32 | 5,300,000.00 | 4,729,932.00 | |
| | | T 1.875 02/15/41 | 3,300,000.00 | 2,479,125.00 | |
| | | T 1.875 02/15/51 | 3,800,000.00 | 2,473,838.00 | |
| | | T 1.875 02/28/27 | 3,400,000.00 | 3,273,146.00 | |
| | | T 1.875 02/28/29 | 2,800,000.00 | 2,621,864.00 | |
| | | T 1.875 07/31/26 | 2,500,000.00 | 2,422,925.00 | |
| | | T 1.875 11/15/51 | 3,300,000.00 | 2,136,849.00 | |
| | | T 2 02/15/50 | 2,800,000.00 | 1,890,980.00 | |
| | | T 2 08/15/51 | 2,900,000.00 | 1,940,042.00 | |
| | | T 2 11/15/26 | 1,000,000.00 | 968,350.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 2 11/15/41 | 2,800,000.00 | 2,110,220.00 | |
| | | T 2.25 02/15/27 | 4,400,000.00 | 4,274,688.00 | |
| | | T 2.25 02/15/52 | 1,700,000.00 | 1,204,773.00 | |
| | | T 2.25 03/31/26 | 8,200,000.00 | 8,025,094.00 | |
| | | T 2.25 05/15/41 | 3,000,000.00 | 2,379,840.00 | |
| | | T 2.25 08/15/27 | 2,200,000.00 | 2,127,554.00 | |
| | | T 2.25 08/15/46 | 1,950,000.00 | 1,441,245.00 | |
| | | T 2.25 08/15/49 | 1,500,000.00 | 1,075,605.00 | |
| | | T 2.25 11/15/25 | 4,000,000.00 | 3,926,840.00 | |
| | | T 2.25 11/15/27 | 4,400,000.00 | 4,244,108.00 | |
| | | T 2.375 02/15/42 | 2,800,000.00 | 2,232,104.00 | |
| | | T 2.375 03/31/29 | 5,000,000.00 | 4,779,250.00 | |
| | | T 2.375 05/15/27 | 3,000,000.00 | 2,917,020.00 | |
| | | T 2.375 05/15/29 | 2,400,000.00 | 2,291,568.00 | |
| | | T 2.375 05/15/51 | 3,900,000.00 | 2,851,251.00 | |
| | | T 2.375 11/15/49 | 1,900,000.00 | 1,397,336.00 | |
| | | T 2.5 02/15/45 | 1,400,000.00 | 1,100,148.00 | |
| | | T 2.5 02/15/46 | 1,000,000.00 | 778,820.00 | |
| | | T 2.5 02/28/26 | 2,100,000.00 | 2,063,733.00 | |
| | | T 2.5 03/31/27 | 3,000,000.00 | 2,931,300.00 | |
| | | T 2.5 05/15/46 | 1,000,000.00 | 776,910.00 | |
| | | T 2.625 01/31/26 | 2,200,000.00 | 2,167,330.00 | |
| | | T 2.625 02/15/29 | 1,800,000.00 | 1,741,320.00 | |
| | | T 2.625 05/31/27 | 4,800,000.00 | 4,697,616.00 | |
| | | T 2.625 07/31/29 | 1,100,000.00 | 1,060,246.00 | |
| | | T 2.625 12/31/25 | 1,400,000.00 | 1,379,434.00 | |
| | | T 2.75 02/15/28 | 5,300,000.00 | 5,182,976.00 | |
| | | T 2.75 04/30/27 | 1,600,000.00 | 1,571,744.00 | |
| | | T 2.75 05/31/29 | 1,400,000.00 | 1,358,756.00 | |
| | | T 2.75 08/15/32 | 4,200,000.00 | 3,969,294.00 | |
| | | T 2.75 08/15/42 | 1,000,000.00 | 841,230.00 | |
| | | T 2.75 08/15/47 | 1,800,000.00 | 1,448,820.00 | |
| | | T 2.75 08/31/25 | 3,400,000.00 | 3,360,186.00 | |
| | | T 2.75 11/15/42 | 300,000.00 | 251,706.00 | |
| | | T 2.75 11/15/47 | 1,500,000.00 | 1,205,295.00 | |
| | | T 2.875 04/30/29 | 3,500,000.00 | 3,417,260.00 | |
| | | T 2.875 05/15/28 | 3,500,000.00 | 3,432,660.00 | |
| | | T 2.875 05/15/32 | 5,700,000.00 | 5,447,148.00 | |
| | | T 2.875 05/15/43 | 1,200,000.00 | 1,019,520.00 | |
| | | T 2.875 05/15/49 | 1,400,000.00 | 1,142,120.00 | |
| | | T 2.875 05/15/52 | 3,200,000.00 | 2,599,296.00 | |
| | | T 2.875 08/15/28 | 4,500,000.00 | 4,408,830.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 2.875 08/15/45 | 800,000.00 | 668,872.00 | |
| | | T 2.875 11/15/46 | 1,000,000.00 | 828,590.00 | |
| | | T 2.875 11/30/25 | 2,500,000.00 | 2,471,475.00 | |
| | | T 3 02/15/47 | 1,500,000.00 | 1,267,845.00 | |
| | | T 3 02/15/48 | 2,400,000.00 | 2,014,200.00 | |
| | | T 3 02/15/49 | 2,300,000.00 | 1,922,110.00 | |
| | | T 3 05/15/42 | 800,000.00 | 701,544.00 | |
| | | T 3 05/15/45 | 900,000.00 | 769,248.00 | |
| | | T 3 05/15/47 | 1,700,000.00 | 1,434,103.00 | |
| | | T 3 08/15/48 | 2,000,000.00 | 1,674,320.00 | |
| | | T 3 08/15/52 | 3,000,000.00 | 2,500,470.00 | |
| | | T 3 09/30/25 | 1,000,000.00 | 990,270.00 | |
| | | T 3 10/31/25 | 2,600,000.00 | 2,574,390.00 | |
| | | T 3 11/15/44 | 1,000,000.00 | 856,640.00 | |
| | | T 3 11/15/45 | 800,000.00 | 682,368.00 | |
| | | T 3.125 02/15/42 | 1,000,000.00 | 898,330.00 | |
| | | T 3.125 02/15/43 | 1,800,000.00 | 1,593,558.00 | |
| | | T 3.125 05/15/48 | 2,400,000.00 | 2,057,568.00 | |
| | | T 3.125 08/15/44 | 700,000.00 | 612,661.00 | |
| | | T 3.125 08/31/29 | 2,700,000.00 | 2,661,606.00 | |
| | | T 3.125 11/15/28 | 2,900,000.00 | 2,864,939.00 | |
| | | T 3.125 11/15/41 | 1,000,000.00 | 903,120.00 | |
| | | T 3.25 05/15/42 | 2,200,000.00 | 1,997,864.00 | |
| | | T 3.25 06/30/29 | 3,000,000.00 | 2,974,920.00 | |
| | | T 3.375 05/15/33 | 5,500,000.00 | 5,415,850.00 | |
| | | T 3.375 05/15/44 | 500,000.00 | 455,175.00 | |
| | | T 3.375 08/15/42 | 2,000,000.00 | 1,845,000.00 | |
| | | T 3.375 11/15/48 | 3,100,000.00 | 2,771,028.00 | |
| | | T 3.5 01/31/28 | 1,000,000.00 | 1,002,300.00 | |
| | | T 3.5 01/31/30 | 2,500,000.00 | 2,505,500.00 | |
| | | T 3.5 02/15/33 | 4,200,000.00 | 4,178,412.00 | |
| | | T 3.5 02/15/39 | 200,000.00 | 195,084.00 | |
| | | T 3.5 04/30/28 | 3,000,000.00 | 3,007,890.00 | |
| | | T 3.5 04/30/30 | 2,500,000.00 | 2,505,075.00 | |
| | | T 3.625 02/15/44 | 300,000.00 | 283,650.00 | |
| | | T 3.625 02/15/53 | 2,700,000.00 | 2,540,835.00 | |
| | | T 3.625 03/31/28 | 3,000,000.00 | 3,020,670.00 | |
| | | T 3.625 03/31/30 | 1,200,000.00 | 1,210,068.00 | |
| | | T 3.625 05/15/26 | 2,500,000.00 | 2,498,775.00 | |
| | | T 3.625 05/15/53 | 2,900,000.00 | 2,732,438.00 | |
| | | T 3.625 05/31/28 | 2,000,000.00 | 2,013,860.00 | |
| | | T 3.625 08/15/43 | 500,000.00 | 473,885.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 3.75 04/15/26 | 3,300,000.00 | 3,303,927.00 | |
| | | T 3.75 05/31/30 | 3,000,000.00 | 3,043,710.00 | |
| | | T 3.75 06/30/30 | 4,400,000.00 | 4,463,756.00 | |
| | | T 3.75 08/15/41 | 1,100,000.00 | 1,084,402.00 | |
| | | T 3.75 11/15/43 | 700,000.00 | 674,646.00 | |
| | | T 3.75 12/31/28 | 1,000,000.00 | 1,013,000.00 | |
| | | T 3.75 12/31/30 | 2,400,000.00 | 2,435,760.00 | |
| | | T 3.875 01/15/26 | 5,300,000.00 | 5,306,996.00 | |
| | | T 3.875 02/15/43 | 2,600,000.00 | 2,564,900.00 | |
| | | T 3.875 05/15/43 | 2,200,000.00 | 2,165,526.00 | |
| | | T 3.875 08/15/33 | 5,000,000.00 | 5,105,650.00 | |
| | | T 3.875 08/15/34 | 2,100,000.00 | 2,144,121.00 | |
| | | T 3.875 08/15/40 | 500,000.00 | 504,390.00 | |
| | | T 3.875 09/30/29 | 2,300,000.00 | 2,345,586.00 | |
| | | T 3.875 12/31/27 | 4,400,000.00 | 4,462,612.00 | |
| | | T 3.875 12/31/29 | 1,500,000.00 | 1,530,165.00 | |
| | | T 4 01/15/27 | 4,900,000.00 | 4,953,851.00 | |
| | | T 4 01/31/29 | 4,100,000.00 | 4,195,981.00 | |
| | | T 4 02/15/26 | 2,000,000.00 | 2,007,560.00 | |
| | | T 4 02/15/34 | 5,100,000.00 | 5,256,570.00 | |
| | | T 4 02/28/30 | 1,500,000.00 | 1,540,485.00 | |
| | | T 4 02/29/28 | 5,000,000.00 | 5,092,950.00 | |
| | | T 4 06/30/28 | 3,000,000.00 | 3,061,680.00 | |
| | | T 4 07/31/29 | 2,500,000.00 | 2,564,625.00 | |
| | | T 4 07/31/30 | 2,200,000.00 | 2,261,358.00 | |
| | | T 4 10/31/29 | 1,600,000.00 | 1,641,056.00 | |
| | | T 4 11/15/42 | 2,000,000.00 | 2,010,660.00 | |
| | | T 4 11/15/52 | 2,600,000.00 | 2,612,740.00 | |
| | | T 4.125 02/15/27 | 5,500,000.00 | 5,579,475.00 | |
| | | T 4.125 03/31/29 | 3,000,000.00 | 3,088,230.00 | |
| | | T 4.125 03/31/31 | 2,000,000.00 | 2,073,780.00 | |
| | | T 4.125 06/15/26 | 2,000,000.00 | 2,016,740.00 | |
| | | T 4.125 07/31/28 | 1,000,000.00 | 1,025,230.00 | |
| | | T 4.125 07/31/31 | 2,000,000.00 | 2,075,920.00 | |
| | | T 4.125 08/15/53 | 3,100,000.00 | 3,192,008.00 | |
| | | T 4.125 08/31/30 | 1,700,000.00 | 1,759,058.00 | |
| | | T 4.125 10/31/27 | 3,500,000.00 | 3,571,365.00 | |
| | | T 4.125 11/15/32 | 5,600,000.00 | 5,827,584.00 | |
| | | T 4.25 01/31/26 | 3,300,000.00 | 3,321,186.00 | |
| | | T 4.25 02/15/54 | 3,500,000.00 | 3,685,920.00 | |
| | | T 4.25 02/28/29 | 2,500,000.00 | 2,586,175.00 | |
| | | T 4.25 02/28/31 | 2,000,000.00 | 2,087,640.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 4.25 03/15/27 | 3,900,000.00 | 3,973,047.00 | |
| | | T 4.25 05/15/39 | 100,000.00 | 105,601.00 | |
| | | T 4.25 08/15/54 | 1,100,000.00 | 1,161,182.00 | |
| | | T 4.25 10/15/25 | 2,000,000.00 | 2,006,480.00 | |
| | | T 4.25 11/15/40 | 600,000.00 | 632,142.00 | |
| | | T 4.25 12/31/25 | 5,800,000.00 | 5,831,378.00 | |
| | | T 4.375 05/15/34 | 5,500,000.00 | 5,837,260.00 | |
| | | T 4.375 05/15/40 | 900,000.00 | 962,874.00 | |
| | | T 4.375 05/15/41 | 300,000.00 | 320,367.00 | |
| | | T 4.375 07/15/27 | 1,000,000.00 | 1,024,800.00 | |
| | | T 4.375 07/31/26 | 2,600,000.00 | 2,636,556.00 | |
| | | T 4.375 08/15/26 | 4,000,000.00 | 4,059,280.00 | |
| | | T 4.375 08/15/43 | 2,000,000.00 | 2,104,140.00 | |
| | | T 4.375 08/31/28 | 1,000,000.00 | 1,034,840.00 | |
| | | T 4.375 11/15/39 | 300,000.00 | 320,805.00 | |
| | | T 4.375 11/30/28 | 1,900,000.00 | 1,970,281.00 | |
| | | T 4.375 11/30/30 | 1,900,000.00 | 1,993,689.00 | |
| | | T 4.375 12/15/26 | 4,000,000.00 | 4,074,120.00 | |
| | | T 4.5 02/15/44 | 2,100,000.00 | 2,241,078.00 | |
| | | T 4.5 03/31/26 | 2,500,000.00 | 2,529,625.00 | |
| | | T 4.5 05/15/38 | 1,200,000.00 | 1,304,244.00 | |
| | | T 4.5 05/31/29 | 1,500,000.00 | 1,570,545.00 | |
| | | T 4.5 07/15/26 | 3,900,000.00 | 3,961,230.00 | |
| | | T 4.5 08/15/39 | 300,000.00 | 325,089.00 | |
| | | T 4.5 11/15/25 | 3,800,000.00 | 3,826,638.00 | |
| | | T 4.5 11/15/33 | 4,800,000.00 | 5,135,616.00 | |
| | | T 4.625 02/15/40 | 1,000,000.00 | 1,098,630.00 | |
| | | T 4.625 03/15/26 | 2,500,000.00 | 2,533,050.00 | |
| | | T 4.625 04/30/29 | 2,500,000.00 | 2,628,125.00 | |
| | | T 4.625 04/30/31 | 1,000,000.00 | 1,066,480.00 | |
| | | T 4.625 05/15/44 | 700,000.00 | 758,947.00 | |
| | | T 4.625 05/15/54 | 700,000.00 | 784,322.00 | |
| | | T 4.625 05/31/31 | 2,900,000.00 | 3,093,633.00 | |
| | | T 4.625 09/15/26 | 4,000,000.00 | 4,081,480.00 | |
| | | T 4.625 09/30/28 | 2,500,000.00 | 2,612,350.00 | |
| | | T 4.625 09/30/30 | 1,500,000.00 | 1,593,075.00 | |
| | | T 4.625 10/15/26 | 2,300,000.00 | 2,349,404.00 | |
| | | T 4.625 11/15/26 | 4,800,000.00 | 4,908,336.00 | |
| | | T 4.75 02/15/41 | 900,000.00 | 1,003,986.00 | |
| | | T 4.75 11/15/43 | 2,200,000.00 | 2,428,030.00 | |
| | | T 4.75 11/15/53 | 3,300,000.00 | 3,763,914.00 | |
| | | T 4.875 10/31/28 | 1,400,000.00 | 1,477,406.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 4.875 11/30/25 | 1,200,000.00 | 1,214,148.00 | |
| | | T 5.25 11/15/28 | 500,000.00 | 535,605.00 | |
| | | T 5.375 02/15/31 | 320,000.00 | 355,760.00 | |
| | | T 6 02/15/26 | 1,000,000.00 | 1,033,880.00 | |
| | | T 6.125 11/15/27 | 1,000,000.00 | 1,080,970.00 | |
| | アメリカ・ドル小計 | | 619,920,000.00 | 585,099,150.50<br>(82,364,407,416) | |
| | カナダ・ドル | CAN 0.5 09/01/25 | 2,300,000.00 | 2,238,705.00 | |
| | | CAN 1 06/01/27 | 800,000.00 | 766,504.00 | |
| | | CAN 1.25 03/01/27 | 400,000.00 | 385,864.00 | |
| | | CAN 1.25 06/01/30 | 2,100,000.00 | 1,939,791.00 | |
| | | CAN 1.5 06/01/26 | 2,600,000.00 | 2,540,018.00 | |
| | | CAN 1.5 12/01/31 | 2,100,000.00 | 1,928,745.00 | |
| | | CAN 1.75 12/01/53 | 1,100,000.00 | 823,669.00 | |
| | | CAN 2 06/01/28 | 700,000.00 | 684,439.00 | |
| | | CAN 2 06/01/32 | 2,000,000.00 | 1,892,940.00 | |
| | | CAN 2.25 06/01/29 | 1,100,000.00 | 1,083,962.00 | |
| | | CAN 2.25 12/01/29 | 1,600,000.00 | 1,570,208.00 | |
| | | CAN 2.5 12/01/32 | 2,930,000.00 | 2,868,264.90 | |
| | | CAN 2.75 06/01/33 | 1,800,000.00 | 1,792,242.00 | |
| | | CAN 2.75 09/01/27 | 2,600,000.00 | 2,603,250.00 | |
| | | CAN 2.75 12/01/48 | 1,300,000.00 | 1,233,726.00 | |
| | | CAN 2.75 12/01/55 | 800,000.00 | 751,120.00 | |
| | | CAN 3 04/01/26 | 400,000.00 | 399,784.00 | |
| | | CAN 3 10/01/25 | 900,000.00 | 897,480.00 | |
| | | CAN 3.25 12/01/33 | 880,000.00 | 909,506.40 | |
| | | CAN 3.5 03/01/34 | 300,000.00 | 316,689.00 | |
| | | CAN 3.5 12/01/45 | 1,200,000.00 | 1,285,752.00 | |
| | | CAN 4 06/01/41 | 1,300,000.00 | 1,467,310.00 | |
| | | CAN 4.5 11/01/25 | 1,800,000.00 | 1,824,282.00 | |
| | | CAN 5 06/01/37 | 400,000.00 | 486,232.00 | |
| | | CAN 5.75 06/01/29 | 250,000.00 | 284,540.00 | |
| | | CAN 5.75 06/01/33 | 300,000.00 | 366,942.00 | |
| | | CANADA 2.75 12/01/64 | 700,000.00 | 661,941.00 | |
| | カナダ・ドル小計 | | 34,660,000.00 | 34,003,906.30<br>(3,521,444,536) | |
| | オーストラリア・ドル | ACGB 0.25 11/21/25 | 1,150,000.00 | 1,104,437.00 | |
| | | ACGB 0.5 09/21/26 | 200,000.00 | 188,560.00 | |
| | | ACGB 1.25 05/21/32 | 1,300,000.00 | 1,088,464.00 | |
| | | ACGB 1.5 06/21/31 | 3,900,000.00 | 3,408,834.00 | |
| | | ACGB 1.75 06/21/51 | 500,000.00 | 294,390.00 | |
| | | ACGB 1.75 11/21/32 | 1,400,000.00 | 1,204,602.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | ACGB 2.25 05/21/28 | 1,300,000.00 | 1,249,352.00 | |
| | ACGB 2.5 05/21/30 | 1,600,000.00 | 1,517,488.00 | |
| | ACGB 2.75 05/21/41 | 600,000.00 | 498,720.00 | |
| | ACGB 2.75 06/21/35 | 800,000.00 | 722,440.00 | |
| | ACGB 2.75 11/21/27 | 1,200,000.00 | 1,176,984.00 | |
| | ACGB 2.75 11/21/28 | 200,000.00 | 195,052.00 | |
| | ACGB 2.75 11/21/29 | 1,800,000.00 | 1,739,898.00 | |
| | ACGB 3 03/21/47 | 1,200,000.00 | 971,952.00 | |
| | ACGB 3 11/21/33 | 900,000.00 | 845,055.00 | |
| | ACGB 3.25 04/21/29 | 800,000.00 | 794,224.00 | |
| | ACGB 3.25 06/21/39 | 2,000,000.00 | 1,825,680.00 | |
| | ACGB 3.5 12/21/34 | 600,000.00 | 583,110.00 | |
| | ACGB 3.75 04/21/37 | 1,100,000.00 | 1,081,366.00 | |
| | ACGB 3.75 05/21/34 | 200,000.00 | 199,020.00 | |
| | ACGB 4.25 04/21/26 | 2,150,000.00 | 2,173,564.00 | |
| | ACGB 4.25 06/21/34 | 100,000.00 | 103,565.00 | |
| | ACGB 4.5 04/21/33 | 1,500,000.00 | 1,580,925.00 | |
| オーストラリア・ドル小計 | | 26,500,000.00 | 24,547,682.00<br>(2,329,329,545) | |
| シンガポール・ドル | SIGB 0.5 11/01/25 | 200,000.00 | 195,518.00 | |
| | SIGB 1.25 11/01/26 | 800,000.00 | 783,096.00 | |
| | SIGB 1.625 07/01/31 | 300,000.00 | 286,956.00 | |
| | SIGB 2.625 05/01/28 | 800,000.00 | 810,560.00 | |
| | SIGB 2.625 08/01/32 | 200,000.00 | 203,700.00 | |
| | SIGB 2.75 03/01/46 | 1,000,000.00 | 1,037,510.00 | |
| | SIGB 2.75 04/01/42 | 550,000.00 | 569,800.00 | |
| | SIGB 2.875 07/01/29 | 100,000.00 | 102,694.00 | |
| | SIGB 2.875 09/01/30 | 600,000.00 | 619,980.00 | |
| | SIGB 3.25 06/01/54 | 600,000.00 | 691,950.00 | |
| | SIGB 3.375 05/01/34 | 200,000.00 | 216,124.00 | |
| | SIGB 3.375 09/01/33 | 400,000.00 | 431,200.00 | |
| | SIGB 3.5 03/01/27 | 880,000.00 | 906,848.80 | |
| シンガポール・ドル小計 | | 6,630,000.00 | 6,855,936.80<br>(744,486,177) | |
| ニュージーランド・ドル | NZGB 0.5 05/15/26 | 200,000.00 | 189,412.00 | |
| | NZGB 1.5 05/15/31 | 200,000.00 | 172,470.00 | |
| | NZGB 1.75 05/15/41 | 1,200,000.00 | 814,128.00 | |
| | NZGB 2 05/15/32 | 1,120,000.00 | 975,934.40 | |
| | NZGB 2.75 05/15/51 | 500,000.00 | 359,410.00 | |
| | NZGB 3 04/20/29 | 1,000,000.00 | 972,690.00 | |
| | NZGB 4.25 05/15/34 | 250,000.00 | 253,480.00 | |
| | NZGB 4.5 04/15/27 | 1,100,000.00 | 1,123,705.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | NZGB 4.5 05/15/30 | 720,000.00 | 746,906.40 | |
| ニュージーランド・ドル小計 | | 6,290,000.00 | 5,608,135.80<br>(488,300,384) | |
| イギリス・ポンド | UK TSY GILT 1.125 01/31/39 | 600,000.00 | 413,418.00 | |
| | UKT 0.125 01/30/26 | 1,500,000.00 | 1,432,410.00 | |
| | UKT 0.125 01/31/28 | 1,800,000.00 | 1,612,476.00 | |
| | UKT 0.25 07/31/31 | 1,300,000.00 | 1,042,054.00 | |
| | UKT 0.375 10/22/26 | 2,000,000.00 | 1,871,040.00 | |
| | UKT 0.375 10/22/30 | 1,100,000.00 | 913,803.00 | |
| | UKT 0.5 01/31/29 | 1,850,000.00 | 1,627,741.00 | |
| | UKT 0.5 10/22/61 | 1,200,000.00 | 389,904.00 | |
| | UKT 0.625 07/31/35 | 1,350,000.00 | 972,540.00 | |
| | UKT 0.875 01/31/46 | 400,000.00 | 211,872.00 | |
| | UKT 0.875 07/31/33 | 1,300,000.00 | 1,026,168.00 | |
| | UKT 0.875 10/22/29 | 500,000.00 | 440,210.00 | |
| | UKT 1 01/31/32 | 2,100,000.00 | 1,750,665.00 | |
| | UKT 1.125 10/22/73 | 300,000.00 | 118,350.00 | |
| | UKT 1.25 07/22/27 | 900,000.00 | 845,028.00 | |
| | UKT 1.25 07/31/51 | 1,400,000.00 | 725,578.00 | |
| | UKT 1.25 10/22/41 | 800,000.00 | 519,592.00 | |
| | UKT 1.5 07/22/26 | 1,100,000.00 | 1,057,705.00 | |
| | UKT 1.5 07/22/47 | 1,000,000.00 | 597,250.00 | |
| | UKT 1.625 10/22/28 | 900,000.00 | 838,242.00 | |
| | UKT 1.625 10/22/54 | 500,000.00 | 276,100.00 | |
| | UKT 1.75 01/22/49 | 1,950,000.00 | 1,207,381.50 | |
| | UKT 1.75 09/07/37 | 700,000.00 | 547,939.00 | |
| | UKT 2 09/07/25 | 1,100,000.00 | 1,078,275.00 | |
| | UKT 2.5 07/22/65 | 1,600,000.00 | 1,063,280.00 | |
| | UKT 3.25 01/22/44 | 1,600,000.00 | 1,391,200.00 | |
| | UKT 3.25 01/31/33 | 2,400,000.00 | 2,328,024.00 | |
| | UKT 3.5 01/22/45 | 1,250,000.00 | 1,121,250.00 | |
| | UKT 3.5 07/22/68 | 1,300,000.00 | 1,109,550.00 | |
| | UKT 3.5 10/22/25 | 700,000.00 | 694,897.00 | |
| | UKT 3.75 01/29/38 | 1,100,000.00 | 1,078,693.00 | |
| | UKT 3.75 03/07/27 | 300,000.00 | 299,904.00 | |
| | UKT 3.75 07/22/52 | 1,200,000.00 | 1,089,240.00 | |
| | UKT 3.75 10/22/53 | 1,300,000.00 | 1,174,628.00 | |
| | UKT 4 01/22/60 | 1,300,000.00 | 1,228,058.00 | |
| | UKT 4 10/22/31 | 100,000.00 | 102,326.00 | |
| | UKT 4.125 01/29/27 | 1,700,000.00 | 1,713,226.00 | |
| | UKT 4.125 07/22/29 | 300,000.00 | 306,759.00 | |
| | UKT 4.25 03/07/36 | 700,000.00 | 726,915.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | UKT 4.25 06/07/32 | 500,000.00 | 522,495.00 | |
| | | UKT 4.25 07/31/34 | 450,000.00 | 468,180.00 | |
| | | UKT 4.25 09/07/39 | 600,000.00 | 613,650.00 | |
| | | UKT 4.25 12/07/27 | 1,200,000.00 | 1,226,244.00 | |
| | | UKT 4.25 12/07/40 | 600,000.00 | 609,618.00 | |
| | | UKT 4.25 12/07/46 | 1,500,000.00 | 1,490,370.00 | |
| | | UKT 4.25 12/07/49 | 900,000.00 | 890,838.00 | |
| | | UKT 4.25 12/07/55 | 1,700,000.00 | 1,676,965.00 | |
| | | UKT 4.375 07/31/54 | 350,000.00 | 351,634.50 | |
| | | UKT 4.5 06/07/28 | 550,000.00 | 566,445.00 | |
| | | UKT 4.5 09/07/34 | 400,000.00 | 424,852.00 | |
| | | UKT 4.5 12/07/42 | 1,050,000.00 | 1,091,097.00 | |
| | | UKT 4.625 01/31/34 | 1,800,000.00 | 1,926,504.00 | |
| | | UKT 4.75 10/22/43 | 700,000.00 | 747,425.00 | |
| | | UKT 4.75 12/07/30 | 1,000,000.00 | 1,067,910.00 | |
| | | UKT 4.75 12/07/38 | 1,000,000.00 | 1,082,380.00 | |
| | | UKT 6 12/07/28 | 650,000.00 | 714,187.50 | |
| | イギリス・ポンド小計 | | 59,450,000.00 | 52,414,486.50<br>(9,740,708,171) | |
| | イスラエル・シュケル | ILGOV 1 03/31/30 | 1,400,000.00 | 1,157,982.00 | |
| | | ILGOV 1.3 04/30/32 | 1,000,000.00 | 782,450.00 | |
| | | ILGOV 1.5 05/31/37 | 1,200,000.00 | 806,172.00 | |
| | | ILGOV 2 03/31/27 | 1,500,000.00 | 1,416,720.00 | |
| | | ILGOV 2.25 09/28/28 | 1,900,000.00 | 1,746,062.00 | |
| | | ILGOV 3.75 02/28/29 | 500,000.00 | 484,450.00 | |
| | | ILGOV 3.75 03/31/47 | 3,600,000.00 | 2,869,668.00 | |
| | | ILGOV 3.75 09/30/27 | 1,000,000.00 | 981,400.00 | |
| | | ILGOV 4 03/30/35 | 500,000.00 | 463,340.00 | |
| | | ILGOV 6.25 10/30/26 | 3,300,000.00 | 3,426,852.00 | |
| | イスラエル・シュケル小計 | | 15,900,000.00 | 14,135,096.00<br>(530,761,547) | |
| | デンマーク・クローネ | DGB 0 11/15/31 | 500,000.00 | 435,975.00 | |
| | | DGB 0.25 11/15/52 | 1,800,000.00 | 1,055,052.00 | |
| | | DGB 0.5 11/15/27 | 6,100,000.00 | 5,840,506.00 | |
| | | DGB 0.5 11/15/29 | 5,400,000.00 | 5,030,424.00 | |
| | | DGB 1.75 11/15/25 | 100,000.00 | 99,440.00 | |
| | | DGB 2.25 11/15/33 | 1,200,000.00 | 1,219,656.00 | |
| | | DGB 4.5 11/15/39 | 7,000,000.00 | 8,974,840.00 | |
| | デンマーク・クローネ小計 | | 22,100,000.00 | 22,655,893.00<br>(475,320,635) | |
| | ノルウェー・クロ | NGB 1.375 08/19/30 | 4,200,000.00 | 3,817,044.00 | |
| | | NGB 1.5 02/19/26 | 1,700,000.00 | 1,654,882.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ーネ | NGB 1.75 02/17/27 | 700,000.00 | 677,446.00 | |
| | NGB 1.75 09/06/29 | 5,000,000.00 | 4,696,300.00 | |
| | NGB 2 04/26/28 | 5,900,000.00 | 5,688,426.00 | |
| | NGB 3 08/15/33 | 1,100,000.00 | 1,083,566.00 | |
| | NGB 3.5 10/06/42 | 2,300,000.00 | 2,377,096.00 | |
| | NGB 3.625 04/13/34 | 1,000,000.00 | 1,029,810.00 | |
| ノルウェー・クローネ小計 | | 21,900,000.00 | 21,024,570.00<br>(279,206,290) | |
| スウェーデン・クローナ | SGB 0.125 05/12/31 | 500,000.00 | 449,855.00 | |
| | SGB 0.75 05/12/28 | 3,700,000.00 | 3,586,151.00 | |
| | SGB 0.75 11/12/29 | 4,200,000.00 | 4,009,446.00 | |
| | SGB 1 11/12/26 | 6,400,000.00 | 6,307,712.00 | |
| | SGB 1.75 11/11/33 | 400,000.00 | 397,288.00 | |
| | SGB 3.5 03/30/39 | 4,900,000.00 | 5,778,276.00 | |
| スウェーデン・クローナ小計 | | 20,100,000.00 | 20,528,728.00<br>(283,707,021) | |
| メキシコ・ペソ | MBONO 5.5 03/04/27 | 15,000,000.00 | 13,804,650.00 | |
| | MBONO 5.75 03/05/26 | 19,000,000.00 | 17,950,820.00 | |
| | MBONO 7.5 05/26/33 | 6,000,000.00 | 5,377,020.00 | |
| | MBONO 7.5 06/03/27 | 22,000,000.00 | 21,133,640.00 | |
| | MBONO 7.75 05/29/31 | 27,000,000.00 | 25,066,530.00 | |
| | MBONO 7.75 11/23/34 | 18,000,000.00 | 16,258,860.00 | |
| | MBONO 8 11/07/47 | 13,000,000.00 | 11,121,110.00 | |
| | MBONO 8.5 05/31/29 | 37,000,000.00 | 36,005,440.00 | |
| | MBONO 8.5 11/18/38 | 40,000,000.00 | 37,054,000.00 | |
| メキシコ・ペソ小計 | | 197,000,000.00 | 183,772,070.00<br>(1,344,899,140) | |
| オフショア・人民元 | CGB 1.85 05/15/27 | 11,000,000.00 | 11,109,670.00 | |
| | CGB 1.91 07/15/29 | 5,500,000.00 | 5,550,875.00 | |
| | CGB 1.99 03/15/26 | 35,000,000.00 | 35,333,550.00 | |
| | CGB 2.04 02/25/27 | 76,000,000.00 | 77,059,440.00 | |
| | CGB 2.05 04/15/29 | 25,000,000.00 | 25,376,000.00 | |
| | CGB 2.11 08/25/34 | 20,000,000.00 | 20,075,800.00 | |
| | CGB 2.18 08/15/26 | 22,800,000.00 | 23,127,864.00 | |
| | CGB 2.27 05/25/34 | 17,000,000.00 | 17,293,250.00 | |
| | CGB 2.28 03/25/31 | 28,000,000.00 | 28,623,000.00 | |
| | CGB 2.3 05/15/26 | 17,000,000.00 | 17,247,180.00 | |
| | CGB 2.35 02/25/34 | 22,000,000.00 | 22,525,140.00 | |
| | CGB 2.37 01/15/29 | 19,000,000.00 | 19,534,470.00 | |
| | CGB 2.39 11/15/26 | 72,000,000.00 | 73,409,760.00 | |
| | CGB 2.4 07/15/28 | 38,000,000.00 | 39,054,500.00 | |
| | CGB 2.46 02/15/26 | 29,000,000.00 | 29,402,810.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | CGB 2.48 04/15/27 | 9,000,000.00 | 9,225,090.00 | |
| | CGB 2.5 07/25/27 | 11,000,000.00 | 11,307,010.00 | |
| | CGB 2.52 08/25/33 | 11,000,000.00 | 11,423,720.00 | |
| | CGB 2.54 12/25/30 | 27,000,000.00 | 28,042,470.00 | |
| | CGB 2.55 10/15/28 | 11,000,000.00 | 11,379,940.00 | |
| | CGB 2.6 09/15/30 | 32,000,000.00 | 33,345,280.00 | |
| | CGB 2.62 04/15/28 | 27,000,000.00 | 27,936,360.00 | |
| | CGB 2.62 06/25/30 | 22,000,000.00 | 22,929,280.00 | |
| | CGB 2.62 09/25/29 | 19,000,000.00 | 19,794,580.00 | |
| | CGB 2.64 01/15/28 | 31,500,000.00 | 32,563,125.00 | |
| | CGB 2.67 05/25/33 | 14,000,000.00 | 14,700,700.00 | |
| | CGB 2.67 11/25/33 | 15,000,000.00 | 15,777,000.00 | |
| | CGB 2.69 08/12/26 | 50,000,000.00 | 51,198,000.00 | |
| | CGB 2.8 03/24/29 | 22,000,000.00 | 23,040,600.00 | |
| | CGB 2.8 03/25/30 | 15,000,000.00 | 15,771,300.00 | |
| | CGB 2.8 11/15/32 | 21,000,000.00 | 22,238,790.00 | |
| | CGB 2.88 02/25/33 | 10,900,000.00 | 11,652,536.00 | |
| | CGB 2.91 10/14/28 | 21,000,000.00 | 22,021,860.00 | |
| | CGB 3 10/15/53 | 13,500,000.00 | 15,710,760.00 | |
| | CGB 3.02 05/27/31 | 32,400,000.00 | 34,720,812.00 | |
| | CGB 3.12 10/25/52 | 17,000,000.00 | 20,097,570.00 | |
| | CGB 3.19 04/15/53 | 13,000,000.00 | 15,600,650.00 | |
| | CGB 3.72 04/12/51 | 38,700,000.00 | 50,056,128.00 | |
| オフショア・人民元小計 | | 921,300,000.00 | 965,256,870.00<br>(19,125,503,096) | |
| マレーシア・リンギット | MGS 3.502 05/31/27 | 5,100,000.00 | 5,123,613.00 | |
| | MGS 3.582 07/15/32 | 2,500,000.00 | 2,476,050.00 | |
| | MGS 3.757 05/22/40 | 1,400,000.00 | 1,367,520.00 | |
| | MGS 3.9 11/30/26 | 1,300,000.00 | 1,317,719.00 | |
| | MGS 3.955 09/15/25 | 3,200,000.00 | 3,224,128.00 | |
| | MGS 4.498 04/15/30 | 4,000,000.00 | 4,185,160.00 | |
| | MGS 4.504 04/30/29 | 700,000.00 | 730,716.00 | |
| | MGS 4.696 10/15/42 | 2,200,000.00 | 2,394,018.00 | |
| | MGS 4.736 03/15/46 | 6,700,000.00 | 7,330,470.00 | |
| マレーシア・リンギット小計 | | 27,100,000.00 | 28,149,394.00<br>(921,901,098) | |
| ポーランド・ズロチ | POLGB 0 10/25/25 | 2,200,000.00 | 2,104,784.00 | |
| | POLGB 0.25 10/25/26 | 7,900,000.00 | 7,221,864.00 | |
| | POLGB 1.25 10/25/30 | 10,200,000.00 | 8,214,060.00 | |
| | POLGB 2.75 04/25/28 | 4,000,000.00 | 3,738,040.00 | |
| | POLGB 2.75 10/25/29 | 700,000.00 | 632,611.00 | |
| | POLGB 6 10/25/33 | 2,800,000.00 | 2,962,260.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | POLGB 7.5 07/25/28 | 1,050,000.00 | 1,146,432.00 | |
| ポーランド・ズロチ小計 | | 28,850,000.00 | 26,020,051.00<br>(952,250,602) | |
| ユーロ | BGB 0 10/22/27 | 650,000.00 | 606,619.00 | |
| | BGB 0 10/22/31 | 1,500,000.00 | 1,261,200.00 | |
| | BGB 0.1 06/22/30 | 700,000.00 | 614,726.00 | |
| | BGB 0.35 06/22/32 | 1,200,000.00 | 1,015,788.00 | |
| | BGB 0.4 06/22/40 | 800,000.00 | 536,176.00 | |
| | BGB 0.65 06/22/71 | 400,000.00 | 176,008.00 | |
| | BGB 0.8 06/22/27 | 800,000.00 | 769,336.00 | |
| | BGB 0.8 06/22/28 | 700,000.00 | 663,992.00 | |
| | BGB 0.9 06/22/29 | 900,000.00 | 843,444.00 | |
| | BGB 1 06/22/26 | 700,000.00 | 684,257.00 | |
| | BGB 1 06/22/31 | 1,100,000.00 | 1,002,078.00 | |
| | BGB 1.25 04/22/33 | 900,000.00 | 811,503.00 | |
| | BGB 1.45 06/22/37 | 1,000,000.00 | 846,830.00 | |
| | BGB 1.6 06/22/47 | 650,000.00 | 483,216.50 | |
| | BGB 1.7 06/22/50 | 1,100,000.00 | 805,662.00 | |
| | BGB 1.9 06/22/38 | 700,000.00 | 616,882.00 | |
| | BGB 2.15 06/22/66 | 500,000.00 | 382,330.00 | |
| | BGB 2.25 06/22/57 | 500,000.00 | 395,595.00 | |
| | BGB 2.85 10/22/34 | 200,000.00 | 202,426.00 | |
| | BGB 3 06/22/34 | 200,000.00 | 205,846.00 | |
| | BGB 3.45 06/22/43 | 500,000.00 | 521,275.00 | |
| | BGB 3.75 06/22/45 | 600,000.00 | 651,930.00 | |
| | BGB 4 03/28/32 | 300,000.00 | 329,847.00 | |
| | BGB 4.25 03/28/41 | 680,000.00 | 782,455.60 | |
| | BGB 4.5 03/28/26 | 650,000.00 | 670,169.50 | |
| | BGB 5 03/28/35 | 1,000,000.00 | 1,202,460.00 | |
| | BGB 5.5 03/28/28 | 1,000,000.00 | 1,108,610.00 | |
| | BKO 2.5 03/19/26 | 2,100,000.00 | 2,105,082.00 | |
| | BKO 3.1 09/18/25 | 300,000.00 | 301,413.00 | |
| | BTPS 0 08/01/26 | 1,300,000.00 | 1,240,421.00 | |
| | BTPS 0.45 02/15/29 | 2,400,000.00 | 2,176,080.00 | |
| | BTPS 0.5 02/01/26 | 1,500,000.00 | 1,457,055.00 | |
| | BTPS 0.85 01/15/27 | 900,000.00 | 867,060.00 | |
| | BTPS 0.9 04/01/31 | 2,000,000.00 | 1,753,820.00 | |
| | BTPS 0.95 03/01/37 | 1,000,000.00 | 738,160.00 | |
| | BTPS 0.95 06/01/32 | 3,300,000.00 | 2,816,253.00 | |
| | BTPS 0.95 08/01/30 | 1,200,000.00 | 1,073,520.00 | |
| | BTPS 0.95 09/15/27 | 800,000.00 | 763,920.00 | |
| | BTPS 0.95 12/01/31 | 900,000.00 | 778,590.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | BTPS 1.1 04/01/27 | 1,500,000.00 | 1,448,415.00 | |
| | | BTPS 1.25 12/01/26 | 800,000.00 | 779,040.00 | |
| | | BTPS 1.35 04/01/30 | 1,900,000.00 | 1,754,631.00 | |
| | | BTPS 1.45 03/01/36 | 400,000.00 | 323,180.00 | |
| | | BTPS 1.6 06/01/26 | 1,200,000.00 | 1,181,508.00 | |
| | | BTPS 1.65 12/01/30 | 1,100,000.00 | 1,018,270.00 | |
| | | BTPS 1.7 09/01/51 | 1,500,000.00 | 953,580.00 | |
| | | BTPS 2 02/01/28 | 1,500,000.00 | 1,472,700.00 | |
| | | BTPS 2 12/01/25 | 1,300,000.00 | 1,289,873.00 | |
| | | BTPS 2.05 08/01/27 | 1,300,000.00 | 1,283,308.00 | |
| | | BTPS 2.1 07/15/26 | 1,000,000.00 | 992,480.00 | |
| | | BTPS 2.2 06/01/27 | 900,000.00 | 892,962.00 | |
| | | BTPS 2.25 09/01/36 | 500,000.00 | 438,395.00 | |
| | | BTPS 2.45 09/01/33 | 600,000.00 | 563,982.00 | |
| | | BTPS 2.45 09/01/50 | 1,700,000.00 | 1,285,965.00 | |
| | | BTPS 2.5 11/15/25 | 200,000.00 | 199,638.00 | |
| | | BTPS 2.65 12/01/27 | 400,000.00 | 401,244.00 | |
| | | BTPS 2.7 03/01/47 | 950,000.00 | 778,848.00 | |
| | | BTPS 2.8 03/01/67 | 700,000.00 | 533,505.00 | |
| | | BTPS 2.8 06/15/29 | 1,000,000.00 | 1,001,440.00 | |
| | | BTPS 2.8 12/01/28 | 1,300,000.00 | 1,307,579.00 | |
| | | BTPS 2.95 02/15/27 | 2,000,000.00 | 2,018,660.00 | |
| | | BTPS 2.95 09/01/38 | 1,000,000.00 | 920,410.00 | |
| | | BTPS 3 08/01/29 | 2,000,000.00 | 2,021,580.00 | |
| | | BTPS 3.1 03/01/40 | 700,000.00 | 644,595.00 | |
| | | BTPS 3.25 03/01/38 | 800,000.00 | 763,624.00 | |
| | | BTPS 3.25 09/01/46 | 1,100,000.00 | 992,332.00 | |
| | | BTPS 3.35 03/01/35 | 700,000.00 | 695,639.00 | |
| | | BTPS 3.35 07/01/29 | 600,000.00 | 614,640.00 | |
| | | BTPS 3.45 03/01/48 | 1,000,000.00 | 923,990.00 | |
| | | BTPS 3.45 07/15/31 | 170,000.00 | 174,003.50 | |
| | | BTPS 3.5 02/15/31 | 1,000,000.00 | 1,027,740.00 | |
| | | BTPS 3.5 03/01/30 | 1,000,000.00 | 1,034,340.00 | |
| | | BTPS 3.7 06/15/30 | 1,900,000.00 | 1,976,646.00 | |
| | | BTPS 3.85 02/01/35 | 800,000.00 | 827,600.00 | |
| | | BTPS 3.85 07/01/34 | 1,000,000.00 | 1,038,840.00 | |
| | | BTPS 3.85 09/01/49 | 1,100,000.00 | 1,076,075.00 | |
| | | BTPS 3.85 09/15/26 | 2,900,000.00 | 2,972,094.00 | |
| | | BTPS 3.85 12/15/29 | 1,300,000.00 | 1,363,518.00 | |
| | | BTPS 4 02/01/37 | 2,000,000.00 | 2,095,660.00 | |
| | | BTPS 4 04/30/35 | 500,000.00 | 526,810.00 | |
| | | BTPS 4.1 02/01/29 | 1,500,000.00 | 1,583,190.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | BTPS 4.4 05/01/33 | 3,000,000.00 | 3,265,650.00 | |
| | | BTPS 4.5 03/01/26 | 1,300,000.00 | 1,334,203.00 | |
| | | BTPS 4.75 09/01/28 | 1,800,000.00 | 1,939,374.00 | |
| | | BTPS 4.75 09/01/44 | 1,200,000.00 | 1,335,636.00 | |
| | | BTPS 5 08/01/34 | 1,570,000.00 | 1,785,152.80 | |
| | | BTPS 5 08/01/39 | 1,800,000.00 | 2,051,676.00 | |
| | | BTPS 5 09/01/40 | 1,700,000.00 | 1,935,161.00 | |
| | | BTPS 5.75 02/01/33 | 1,700,000.00 | 2,012,783.00 | |
| | | BTPS 6 05/01/31 | 1,200,000.00 | 1,417,320.00 | |
| | | BTPS 6.5 11/01/27 | 1,700,000.00 | 1,901,739.00 | |
| | | BTPS 7.25 11/01/26 | 400,000.00 | 439,044.00 | |
| | | DBR 0 02/15/30 | 1,500,000.00 | 1,352,460.00 | |
| | | DBR 0 02/15/32 | 2,700,000.00 | 2,335,554.00 | |
| | | DBR 0 05/15/35 | 1,600,000.00 | 1,273,504.00 | |
| | | DBR 0 05/15/36 | 800,000.00 | 619,032.00 | |
| | | DBR 0 08/15/29 | 2,500,000.00 | 2,275,100.00 | |
| | | DBR 0 08/15/30 | 2,500,000.00 | 2,232,925.00 | |
| | | DBR 0 08/15/31 | 1,300,000.00 | 1,137,136.00 | |
| | | DBR 0 08/15/31 | 1,700,000.00 | 1,487,364.00 | |
| | | DBR 0 08/15/50 | 2,000,000.00 | 1,088,720.00 | |
| | | DBR 0 08/15/50 | 2,100,000.00 | 1,145,151.00 | |
| | | DBR 0 11/15/27 | 1,000,000.00 | 939,910.00 | |
| | | DBR 0 11/15/28 | 500,000.00 | 461,820.00 | |
| | | DBR 0.25 02/15/27 | 300,000.00 | 287,604.00 | |
| | | DBR 0.25 02/15/29 | 1,200,000.00 | 1,115,844.00 | |
| | | DBR 0.25 08/15/28 | 1,500,000.00 | 1,406,265.00 | |
| | | DBR 0.5 02/15/26 | 3,200,000.00 | 3,121,184.00 | |
| | | DBR 0.5 02/15/28 | 1,600,000.00 | 1,524,960.00 | |
| | | DBR 0.5 08/15/27 | 2,100,000.00 | 2,014,110.00 | |
| | | DBR 1 05/15/38 | 1,600,000.00 | 1,355,760.00 | |
| | | DBR 1.25 08/15/48 | 1,650,000.00 | 1,306,090.50 | |
| | | DBR 1.7 08/15/32 | 2,400,000.00 | 2,347,992.00 | |
| | | DBR 1.8 08/15/53 | 1,200,000.00 | 1,052,088.00 | |
| | | DBR 1.8 08/15/53 | 1,000,000.00 | 878,210.00 | |
| | | DBR 2.1 11/15/29 | 1,400,000.00 | 1,406,734.00 | |
| | | DBR 2.2 02/15/34 | 100,000.00 | 100,929.00 | |
| | | DBR 2.3 02/15/33 | 1,600,000.00 | 1,632,544.00 | |
| | | DBR 2.3 02/15/33 | 1,300,000.00 | 1,327,053.00 | |
| | | DBR 2.4 11/15/30 | 1,100,000.00 | 1,124,475.00 | |
| | | DBR 2.5 07/04/44 | 1,600,000.00 | 1,620,352.00 | |
| | | DBR 2.5 08/15/46 | 1,500,000.00 | 1,520,025.00 | |
| | | DBR 2.5 08/15/54 | 500,000.00 | 510,715.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | DBR 2.6 08/15/33 | 900,000.00 | 939,465.00 | |
| | | DBR 2.6 08/15/34 | 450,000.00 | 469,071.00 | |
| | | DBR 3.25 07/04/42 | 800,000.00 | 897,352.00 | |
| | | DBR 4 01/04/37 | 1,300,000.00 | 1,539,941.00 | |
| | | DBR 4.25 07/04/39 | 700,000.00 | 864,262.00 | |
| | | DBR 4.75 07/04/28 | 1,600,000.00 | 1,760,416.00 | |
| | | DBR 4.75 07/04/34 | 600,000.00 | 739,086.00 | |
| | | DBR 4.75 07/04/40 | 1,450,000.00 | 1,900,834.00 | |
| | | DBR 5.5 01/04/31 | 900,000.00 | 1,083,735.00 | |
| | | DBR 5.625 01/04/28 | 1,000,000.00 | 1,114,630.00 | |
| | | DBR 6.25 01/04/30 | 500,000.00 | 605,645.00 | |
| | | DBR 6.5 07/04/27 | 1,000,000.00 | 1,119,510.00 | |
| | | FRTR 0 02/25/26 | 2,000,000.00 | 1,931,360.00 | |
| | | FRTR 0 02/25/27 | 1,100,000.00 | 1,039,016.00 | |
| | | FRTR 0 05/25/32 | 2,900,000.00 | 2,377,797.00 | |
| | | FRTR 0 11/25/29 | 2,500,000.00 | 2,203,975.00 | |
| | | FRTR 0 11/25/30 | 4,100,000.00 | 3,517,021.00 | |
| | | FRTR 0 11/25/31 | 3,000,000.00 | 2,499,090.00 | |
| | | FRTR 0.25 11/25/26 | 2,900,000.00 | 2,770,515.00 | |
| | | FRTR 0.5 05/25/26 | 3,100,000.00 | 3,003,342.00 | |
| | | FRTR 0.5 05/25/29 | 3,000,000.00 | 2,744,310.00 | |
| | | FRTR 0.5 05/25/40 | 1,300,000.00 | 880,373.00 | |
| | | FRTR 0.5 05/25/72 | 500,000.00 | 191,235.00 | |
| | | FRTR 0.5 06/25/44 | 350,000.00 | 212,810.50 | |
| | | FRTR 0.75 02/25/28 | 4,200,000.00 | 3,976,644.00 | |
| | | FRTR 0.75 05/25/28 | 2,500,000.00 | 2,357,500.00 | |
| | | FRTR 0.75 05/25/52 | 3,000,000.00 | 1,623,960.00 | |
| | | FRTR 0.75 11/25/28 | 3,400,000.00 | 3,177,572.00 | |
| | | FRTR 1 05/25/27 | 2,000,000.00 | 1,930,060.00 | |
| | | FRTR 1 11/25/25 | 800,000.00 | 785,368.00 | |
| | | FRTR 1.25 05/25/34 | 1,500,000.00 | 1,307,340.00 | |
| | | FRTR 1.25 05/25/36 | 1,850,000.00 | 1,545,490.00 | |
| | | FRTR 1.25 05/25/38 | 900,000.00 | 719,091.00 | |
| | | FRTR 1.5 05/25/31 | 2,650,000.00 | 2,483,553.50 | |
| | | FRTR 1.5 05/25/50 | 2,400,000.00 | 1,656,288.00 | |
| | | FRTR 1.75 05/25/66 | 800,000.00 | 526,648.00 | |
| | | FRTR 1.75 06/25/39 | 2,000,000.00 | 1,691,960.00 | |
| | | FRTR 2 05/25/48 | 2,000,000.00 | 1,579,580.00 | |
| | | FRTR 2 11/25/32 | 2,700,000.00 | 2,569,455.00 | |
| | | FRTR 2.5 05/25/30 | 2,100,000.00 | 2,101,533.00 | |
| | | FRTR 2.5 05/25/43 | 1,100,000.00 | 988,042.00 | |
| | | FRTR 2.5 09/24/26 | 3,100,000.00 | 3,106,789.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | FRTR 2.5 09/24/27 | 1,100,000.00 | 1,103,894.00 | |
| | | FRTR 2.75 02/25/29 | 1,600,000.00 | 1,619,824.00 | |
| | | FRTR 2.75 02/25/30 | 600,000.00 | 606,966.00 | |
| | | FRTR 2.75 10/25/27 | 2,650,000.00 | 2,679,812.50 | |
| | | FRTR 3 05/25/33 | 2,200,000.00 | 2,249,698.00 | |
| | | FRTR 3 05/25/54 | 1,300,000.00 | 1,205,854.00 | |
| | | FRTR 3 11/25/34 | 500,000.00 | 507,345.00 | |
| | | FRTR 3.25 05/25/45 | 900,000.00 | 901,179.00 | |
| | | FRTR 3.5 04/25/26 | 1,800,000.00 | 1,829,646.00 | |
| | | FRTR 3.5 11/25/33 | 3,400,000.00 | 3,606,312.00 | |
| | | FRTR 4 04/25/55 | 1,370,000.00 | 1,525,769.00 | |
| | | FRTR 4 04/25/60 | 1,400,000.00 | 1,575,546.00 | |
| | | FRTR 4 10/25/38 | 2,000,000.00 | 2,216,380.00 | |
| | | FRTR 4.5 04/25/41 | 1,900,000.00 | 2,230,809.00 | |
| | | FRTR 4.75 04/25/35 | 800,000.00 | 938,152.00 | |
| | | FRTR 5.5 04/25/29 | 1,650,000.00 | 1,864,747.50 | |
| | | FRTR 5.75 10/25/32 | 400,000.00 | 489,068.00 | |
| | | FRTR 6 10/25/25 | 1,700,000.00 | 1,761,319.00 | |
| | | IRISH 0 10/18/31 | 500,000.00 | 425,405.00 | |
| | | IRISH 0.9 05/15/28 | 500,000.00 | 478,450.00 | |
| | | IRISH 1 05/15/26 | 1,000,000.00 | 978,620.00 | |
| | | IRISH 1.1 05/15/29 | 500,000.00 | 475,785.00 | |
| | | IRISH 1.3 05/15/33 | 250,000.00 | 229,180.00 | |
| | | IRISH 1.35 03/18/31 | 500,000.00 | 472,370.00 | |
| | | IRISH 1.5 05/15/50 | 500,000.00 | 380,415.00 | |
| | | IRISH 1.7 05/15/37 | 300,000.00 | 269,154.00 | |
| | | IRISH 2 02/18/45 | 1,100,000.00 | 962,423.00 | |
| | | IRISH 2.4 05/15/30 | 600,000.00 | 604,728.00 | |
| | | IRISH 2.6 10/18/34 | 300,000.00 | 302,739.00 | |
| | | NETHER 0 01/15/27 | 1,300,000.00 | 1,238,068.00 | |
| | | NETHER 0 07/15/30 | 1,700,000.00 | 1,497,309.00 | |
| | | NETHER 0.25 07/15/29 | 500,000.00 | 456,590.00 | |
| | | NETHER 0.5 01/15/40 | 1,500,000.00 | 1,106,880.00 | |
| | | NETHER 0.5 07/15/26 | 1,300,000.00 | 1,261,130.00 | |
| | | NETHER 0.5 07/15/32 | 1,200,000.00 | 1,047,840.00 | |
| | | NETHER 0.75 07/15/27 | 400,000.00 | 385,220.00 | |
| | | NETHER 0.75 07/15/28 | 1,700,000.00 | 1,614,082.00 | |
| | | NETHER 2 01/15/54 | 200,000.00 | 175,168.00 | |
| | | NETHER 2.5 01/15/33 | 600,000.00 | 607,950.00 | |
| | | NETHER 2.5 07/15/33 | 800,000.00 | 809,232.00 | |
| | | NETHER 2.75 01/15/47 | 2,300,000.00 | 2,353,199.00 | |
| | | NETHER 3.25 01/15/44 | 200,000.00 | 218,540.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| NETHER 3.75 01/15/42 | 1,300,000.00 | 1,502,046.00 | |
| NETHER 4 01/15/37 | 300,000.00 | 346,269.00 | |
| NETHER 5.5 01/15/28 | 700,000.00 | 774,333.00 | |
| OBL 0 04/10/26 | 2,100,000.00 | 2,029,104.00 | |
| OBL 0 04/16/27 | 2,200,000.00 | 2,088,988.00 | |
| OBL 0 10/09/26 | 2,700,000.00 | 2,586,546.00 | |
| OBL 1.3 10/15/27 | 300,000.00 | 294,048.00 | |
| OBL 2.1 04/12/29 | 1,000,000.00 | 1,004,350.00 | |
| OBL 2.1 04/12/29 | 600,000.00 | 602,850.00 | |
| OBL 2.2 04/13/28 | 600,000.00 | 604,260.00 | |
| OBL 2.4 10/19/28 | 1,600,000.00 | 1,625,088.00 | |
| RAGB 0 02/20/30 | 800,000.00 | 703,736.00 | |
| RAGB 0 02/20/31 | 1,400,000.00 | 1,197,798.00 | |
| RAGB 0 10/20/40 | 300,000.00 | 189,222.00 | |
| RAGB 0.5 02/20/29 | 550,000.00 | 508,821.50 | |
| RAGB 0.5 04/20/27 | 700,000.00 | 669,669.00 | |
| RAGB 0.75 02/20/28 | 600,000.00 | 570,372.00 | |
| RAGB 0.75 03/20/51 | 900,000.00 | 542,970.00 | |
| RAGB 0.75 10/20/26 | 600,000.00 | 581,454.00 | |
| RAGB 0.85 06/30/20 | 250,000.00 | 118,410.00 | |
| RAGB 0.9 02/20/32 | 600,000.00 | 535,512.00 | |
| RAGB 1.2 10/20/25 | 1,000,000.00 | 985,550.00 | |
| RAGB 1.5 02/20/47 | 700,000.00 | 533,526.00 | |
| RAGB 1.5 11/02/86 | 200,000.00 | 125,808.00 | |
| RAGB 2.4 05/23/34 | 1,000,000.00 | 982,280.00 | |
| RAGB 2.9 02/20/33 | 500,000.00 | 512,055.00 | |
| RAGB 2.9 02/20/34 | 300,000.00 | 306,939.00 | |
| RAGB 3.15 06/20/44 | 500,000.00 | 513,955.00 | |
| RAGB 3.15 10/20/53 | 150,000.00 | 154,087.50 | |
| RAGB 3.2 07/15/39 | 200,000.00 | 207,570.00 | |
| RAGB 3.8 01/26/62 | 700,000.00 | 829,675.00 | |
| RAGB 4.15 03/15/37 | 300,000.00 | 342,480.00 | |
| RAGB 4.85 03/15/26 | 800,000.00 | 827,536.00 | |
| RAGB 6.25 07/15/27 | 1,000,000.00 | 1,108,430.00 | |
| RFGB 0 09/15/26 | 300,000.00 | 286,629.00 | |
| RFGB 0 09/15/30 | 400,000.00 | 346,832.00 | |
| RFGB 0.25 09/15/40 | 700,000.00 | 465,465.00 | |
| RFGB 0.5 04/15/26 | 700,000.00 | 680,176.00 | |
| RFGB 0.5 09/15/27 | 700,000.00 | 665,448.00 | |
| RFGB 0.5 09/15/28 | 300,000.00 | 279,750.00 | |
| RFGB 0.5 09/15/29 | 100,000.00 | 91,324.00 | |
| RFGB 0.75 04/15/31 | 800,000.00 | 718,608.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| RFGB 1.375 04/15/47 | 500,000.00 | 374,635.00 | |
| RFGB 2.625 07/04/42 | 800,000.00 | 769,576.00 | |
| RFGB 2.75 04/15/38 | 200,000.00 | 197,768.00 | |
| RFGB 2.75 07/04/28 | 200,000.00 | 203,540.00 | |
| RFGB 3 09/15/33 | 800,000.00 | 826,608.00 | |
| SPGB 0 01/31/27 | 500,000.00 | 472,745.00 | |
| SPGB 0.1 04/30/31 | 800,000.00 | 681,000.00 | |
| SPGB 0.5 04/30/30 | 1,600,000.00 | 1,435,200.00 | |
| SPGB 0.5 10/31/31 | 1,400,000.00 | 1,210,090.00 | |
| SPGB 0.7 04/30/32 | 1,400,000.00 | 1,213,450.00 | |
| SPGB 0.8 07/30/27 | 1,100,000.00 | 1,053,030.00 | |
| SPGB 0.8 07/30/29 | 700,000.00 | 647,143.00 | |
| SPGB 0.85 07/30/37 | 500,000.00 | 379,395.00 | |
| SPGB 1 10/31/50 | 800,000.00 | 461,464.00 | |
| SPGB 1.2 10/31/40 | 1,400,000.00 | 1,031,058.00 | |
| SPGB 1.25 10/31/30 | 3,000,000.00 | 2,782,830.00 | |
| SPGB 1.3 10/31/26 | 1,400,000.00 | 1,369,494.00 | |
| SPGB 1.4 04/30/28 | 1,500,000.00 | 1,450,035.00 | |
| SPGB 1.4 07/30/28 | 1,200,000.00 | 1,156,968.00 | |
| SPGB 1.45 04/30/29 | 2,100,000.00 | 2,011,548.00 | |
| SPGB 1.45 10/31/27 | 1,300,000.00 | 1,264,848.00 | |
| SPGB 1.45 10/31/71 | 400,000.00 | 209,532.00 | |
| SPGB 1.5 04/30/27 | 1,500,000.00 | 1,467,690.00 | |
| SPGB 1.85 07/30/35 | 600,000.00 | 538,938.00 | |
| SPGB 1.95 04/30/26 | 2,300,000.00 | 2,282,014.00 | |
| SPGB 1.95 07/30/30 | 700,000.00 | 679,119.00 | |
| SPGB 2.15 10/31/25 | 1,600,000.00 | 1,591,408.00 | |
| SPGB 2.35 07/30/33 | 700,000.00 | 676,648.00 | |
| SPGB 2.5 05/31/27 | 1,400,000.00 | 1,403,766.00 | |
| SPGB 2.55 10/31/32 | 1,600,000.00 | 1,581,536.00 | |
| SPGB 2.7 10/31/48 | 750,000.00 | 653,527.50 | |
| SPGB 2.8 05/31/26 | 1,100,000.00 | 1,105,797.00 | |
| SPGB 2.9 10/31/46 | 1,700,000.00 | 1,553,919.00 | |
| SPGB 3.15 04/30/33 | 1,900,000.00 | 1,955,537.00 | |
| SPGB 3.45 07/30/43 | 700,000.00 | 699,741.00 | |
| SPGB 3.45 07/30/66 | 1,300,000.00 | 1,242,826.00 | |
| SPGB 3.45 10/31/34 | 600,000.00 | 627,642.00 | |
| SPGB 3.55 10/31/33 | 1,800,000.00 | 1,904,148.00 | |
| SPGB 3.9 07/30/39 | 700,000.00 | 750,834.00 | |
| SPGB 4.2 01/31/37 | 1,050,000.00 | 1,170,729.00 | |
| SPGB 4.7 07/30/41 | 1,100,000.00 | 1,292,434.00 | |
| SPGB 4.9 07/30/40 | 1,400,000.00 | 1,670,984.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | SPGB 5.15 10/31/28 | 1,500,000.00 | 1,660,020.00 | |
| | | SPGB 5.15 10/31/44 | 1,400,000.00 | 1,746,696.00 | |
| | | SPGB 5.75 07/30/32 | 1,000,000.00 | 1,216,510.00 | |
| | | SPGB 5.9 07/30/26 | 500,000.00 | 531,255.00 | |
| | | SPGB 6 01/31/29 | 1,900,000.00 | 2,181,238.00 | |
| | ユーロ小計 | | 358,690,000.00 | 342,095,260.90<br>(53,555,013,094) | |
| 国債証券合計 | | | | 176,657,238,753<br>(176,657,238,753) | |
| 合　計 | | | | 176,657,238,753<br>(176,657,238,753) | |

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 通　貨 | 銘柄数 | | 組入債券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 国債証券 | 241 銘柄 | 45.9% | 46.6% |
| カナダ・ドル | 国債証券 | 27 銘柄 | 2.0% | 2.0% |
| オーストラリア・ドル | 国債証券 | 23 銘柄 | 1.3% | 1.3% |
| シンガポール・ドル | 国債証券 | 13 銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| ニュージーランド・ドル | 国債証券 | 9 銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| イギリス・ポンド | 国債証券 | 56 銘柄 | 5.4% | 5.5% |
| イスラエル・シュケル | 国債証券 | 10 銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| デンマーク・クローネ | 国債証券 | 7 銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| ノルウェー・クローネ | 国債証券 | 8 銘柄 | 0.2% | 0.2% |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券 | 6 銘柄 | 0.2% | 0.2% |
| メキシコ・ペソ | 国債証券 | 9 銘柄 | 0.7% | 0.8% |
| オフショア・人民元 | 国債証券 | 38 銘柄 | 10.7% | 10.8% |
| マレーシア・リンギット | 国債証券 | 9 銘柄 | 0.5% | 0.5% |
| ポーランド・ズロチ | 国債証券 | 7 銘柄 | 0.5% | 0.5% |
| ユーロ | 国債証券 | 296 銘柄 | 29.8% | 30.3% |

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

（1）貸借対照表

(単位：円)

(2024年9月17日現在)

| | |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 54,658,617 |
| 金銭信託 | 1,648,908 |
| コール・ローン | 163,940,704 |
| 国債証券 | 35,995,014,946 |
| 派生商品評価勘定 | 1,100,915,977 |

| | |
|---|---|
| 未収利息 | 197,559,064 |
| 前払費用 | 93,368,679 |
| 流動資産合計 | 37,607,106,895 |
| 資産合計 | 37,607,106,895 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,844,038 |
| 未払解約金 | 32,490,110 |
| 流動負債合計 | 34,334,148 |
| 負債合計 | 34,334,148 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 30,179,065,454 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 7,393,707,293 |
| 元本等合計 | 37,572,772,747 |
| 純資産合計 | 37,572,772,747 |
| 負債純資産合計 | 37,607,106,895 |

（２）注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項　目 | 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br><br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| ３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。 |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | （2024年9月17日現在） |
|---|---|
| 1．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 30,179,065,454口 |
| 2．　1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額　1.2450円<br>（1万口当たりの純資産額12,450円） |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

| 項　目 | 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
|---|---|
| 1．　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容<br>1) 有価証券<br>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。<br>2) デリバティブ取引<br>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。<br>当計算期間については、為替予約取引を行っております。<br>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>(2) 金融商品に係るリスク<br>有価証券およびデリバティブ取引等<br>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |
| 3．　金融商品に係るリスク管理体制 | リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。<br>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部 |

| | |
|---|---|
| | 署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。<br>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。 |

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | (2024年9月17日現在) |
|---|---|
| 1．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（国債証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区　分 | 種　類 | 契　約　額　等 | | 時　価 | 評価損益 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 33,402,971 | － | 32,303,500 | △1,099,471 |
| | カナダ・ドル | 1,076,790 | － | 1,033,627 | △43,163 |
| | オーストラリア・ドル | 1,964,476 | － | 1,894,174 | △70,302 |
| | デンマーク・クローネ | 215,469 | － | 209,480 | △5,989 |
| | メキシコ・ペソ | 1,978,322 | － | 1,965,654 | △12,668 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ユーロ | 22,491,831 | － | 21,881,902 | △609,929 |
| | 小計 | 61,129,859 | － | 59,288,337 | △1,841,522 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 17,116,557,245 | － | 16,588,549,500 | 528,007,745 |
| | カナダ・ドル | 740,241,648 | － | 711,135,376 | 29,106,272 |
| | オーストラリア・ドル | 491,624,572 | － | 473,543,500 | 18,081,072 |
| | シンガポール・ドル | 338,519,497 | － | 329,611,088 | 8,908,409 |
| | ニュージーランド・ドル | 102,374,761 | － | 98,166,151 | 4,208,610 |
| | イギリス・ポンド | 2,013,352,923 | － | 1,959,931,680 | 53,421,243 |
| | イスラエル・シュケル | 116,330,735 | － | 109,005,981 | 7,324,754 |
| | デンマーク・クローネ | 100,735,779 | － | 98,036,640 | 2,699,139 |
| | ノルウェー・クローネ | 57,914,153 | － | 56,061,459 | 1,852,694 |
| | スウェーデン・クローナ | 55,289,960 | － | 53,814,930 | 1,475,030 |
| | メキシコ・ペソ | 267,650,821 | － | 265,654,498 | 1,996,323 |
| | オフショア・人民元 | 4,042,344,219 | － | 3,903,674,070 | 138,670,149 |
| | ポーランド・ズロチ | 192,422,075 | － | 187,202,934 | 5,219,141 |
| | ユーロ | 11,158,055,251 | － | 10,858,112,371 | 299,942,880 |
| | 小計 | 36,793,413,639 | － | 35,692,500,178 | 1,100,913,461 |
| 合　計 | | 36,854,543,498 | － | 35,751,788,515 | 1,099,071,939 |

（注）１．時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2)計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

| |
|---|
| 自 2023年9月16日<br>至 2024年9月17日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていな |

いため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2024年9月17日現在）

| | |
|---|---|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 15,809,721,819円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 20,671,411,508円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 6,302,067,873円 |
| | |
| 2024年9月17日現在の元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 2,011,510,031円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 2,201,553,605円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 848,422,165円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 1,260,478,663円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 3,398,635,377円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 1,573,946,740円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 2,650,606,842円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 730,726,946円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 97,175,055円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 127,986,090円 |
| 日興ＦＷＳ・先進国債インデックス（為替ヘッジあり） | 331,420,961円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 14,903,918円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 138,921,791円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 367,591,701円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 182,125,785円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 16,859,938円 |
| ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞ | 970,009,355円 |
| ＳＭＡＭ・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞ | 10,283,969,685円 |
| ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 915,871,890円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞ | 512,269,018円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞ | 817,092,061円 |
| ＳＭＤＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定＞ | 726,987,837円 |
| 合　計 | 30,179,065,454円 |

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 国債証券 | アメリ | T 0.25 08/31/25 | 590,000.00 | 569,409.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | カ・ドル | T 0.25 09/30/25 | 290,000.00 | 279,197.50 | |
| | | T 0.25 10/31/25 | 420,000.00 | 403,363.80 | |
| | | T 0.375 01/31/26 | 570,000.00 | 544,412.70 | |
| | | T 0.375 07/31/27 | 100,000.00 | 91,685.00 | |
| | | T 0.375 09/30/27 | 470,000.00 | 428,945.50 | |
| | | T 0.375 11/30/25 | 510,000.00 | 489,350.10 | |
| | | T 0.375 12/31/25 | 500,000.00 | 478,750.00 | |
| | | T 0.5 02/28/26 | 550,000.00 | 525,206.00 | |
| | | T 0.5 05/31/27 | 80,000.00 | 73,944.80 | |
| | | T 0.5 06/30/27 | 310,000.00 | 285,900.60 | |
| | | T 0.5 08/31/27 | 340,000.00 | 312,188.00 | |
| | | T 0.5 10/31/27 | 400,000.00 | 365,468.00 | |
| | | T 0.625 03/31/27 | 120,000.00 | 111,772.80 | |
| | | T 0.625 05/15/30 | 500,000.00 | 427,830.00 | |
| | | T 0.625 07/31/26 | 710,000.00 | 672,334.50 | |
| | | T 0.625 08/15/30 | 750,000.00 | 637,012.50 | |
| | | T 0.625 11/30/27 | 730,000.00 | 668,402.60 | |
| | | T 0.625 12/31/27 | 350,000.00 | 319,756.50 | |
| | | T 0.75 01/31/28 | 460,000.00 | 421,079.40 | |
| | | T 0.75 03/31/26 | 530,000.00 | 506,998.00 | |
| | | T 0.75 04/30/26 | 500,000.00 | 477,300.00 | |
| | | T 0.75 05/31/26 | 2,010,000.00 | 1,914,906.90 | |
| | | T 0.75 08/31/26 | 460,000.00 | 435,822.40 | |
| | | T 0.875 06/30/26 | 390,000.00 | 371,740.20 | |
| | | T 0.875 09/30/26 | 540,000.00 | 512,060.40 | |
| | | T 0.875 11/15/30 | 710,000.00 | 608,846.30 | |
| | | T 1.125 02/15/31 | 530,000.00 | 459,690.20 | |
| | | T 1.125 02/28/27 | 30,000.00 | 28,353.30 | |
| | | T 1.125 02/29/28 | 540,000.00 | 499,759.20 | |
| | | T 1.125 05/15/40 | 630,000.00 | 426,944.70 | |
| | | T 1.125 08/15/40 | 510,000.00 | 342,572.10 | |
| | | T 1.125 08/31/28 | 650,000.00 | 595,166.00 | |
| | | T 1.125 10/31/26 | 130,000.00 | 123,646.90 | |
| | | T 1.25 03/31/28 | 460,000.00 | 426,843.20 | |
| | | T 1.25 04/30/28 | 720,000.00 | 666,950.40 | |
| | | T 1.25 05/15/50 | 500,000.00 | 278,785.00 | |
| | | T 1.25 05/31/28 | 580,000.00 | 536,395.60 | |
| | | T 1.25 06/30/28 | 330,000.00 | 304,698.90 | |
| | | T 1.25 08/15/31 | 920,000.00 | 793,279.20 | |
| | | T 1.25 09/30/28 | 570,000.00 | 523,482.30 | |
| | | T 1.25 11/30/26 | 420,000.00 | 400,033.20 | |
| | | T 1.25 12/31/26 | 850,000.00 | 808,605.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 1.375 08/15/50 | 450,000.00 | 258,219.00 | |
| | | T 1.375 08/31/26 | 240,000.00 | 230,210.40 | |
| | | T 1.375 10/31/28 | 500,000.00 | 460,835.00 | |
| | | T 1.375 11/15/31 | 1,040,000.00 | 899,735.20 | |
| | | T 1.375 11/15/40 | 450,000.00 | 312,817.50 | |
| | | T 1.375 12/31/28 | 510,000.00 | 468,751.20 | |
| | | T 1.5 02/15/30 | 570,000.00 | 515,582.10 | |
| | | T 1.5 11/30/28 | 380,000.00 | 351,534.20 | |
| | | T 1.625 05/15/26 | 120,000.00 | 116,110.80 | |
| | | T 1.625 05/15/31 | 230,000.00 | 204,591.90 | |
| | | T 1.625 08/15/29 | 220,000.00 | 202,441.80 | |
| | | T 1.625 09/30/26 | 110,000.00 | 105,895.90 | |
| | | T 1.625 11/15/50 | 140,000.00 | 85,636.60 | |
| | | T 1.625 11/30/26 | 350,000.00 | 336,024.50 | |
| | | T 1.75 01/31/29 | 450,000.00 | 419,544.00 | |
| | | T 1.75 08/15/41 | 810,000.00 | 588,213.90 | |
| | | T 1.875 02/15/32 | 1,050,000.00 | 937,062.00 | |
| | | T 1.875 02/15/41 | 320,000.00 | 240,400.00 | |
| | | T 1.875 02/15/51 | 390,000.00 | 253,893.90 | |
| | | T 1.875 02/28/27 | 530,000.00 | 510,225.70 | |
| | | T 1.875 02/28/29 | 480,000.00 | 449,462.40 | |
| | | T 1.875 06/30/26 | 200,000.00 | 194,038.00 | |
| | | T 1.875 07/31/26 | 880,000.00 | 852,869.60 | |
| | | T 1.875 11/15/51 | 470,000.00 | 304,339.10 | |
| | | T 2 02/15/50 | 570,000.00 | 384,949.50 | |
| | | T 2 08/15/51 | 460,000.00 | 307,730.80 | |
| | | T 2 11/15/26 | 490,000.00 | 474,491.50 | |
| | | T 2 11/15/41 | 170,000.00 | 128,120.50 | |
| | | T 2.125 05/31/26 | 320,000.00 | 312,048.00 | |
| | | T 2.25 02/15/52 | 300,000.00 | 212,607.00 | |
| | | T 2.25 03/31/26 | 700,000.00 | 685,069.00 | |
| | | T 2.25 05/15/41 | 810,000.00 | 642,556.80 | |
| | | T 2.25 08/15/46 | 250,000.00 | 184,775.00 | |
| | | T 2.25 08/15/49 | 630,000.00 | 451,754.10 | |
| | | T 2.375 02/15/42 | 200,000.00 | 159,436.00 | |
| | | T 2.375 03/31/29 | 90,000.00 | 86,026.50 | |
| | | T 2.375 04/30/26 | 50,000.00 | 48,990.00 | |
| | | T 2.375 05/15/29 | 100,000.00 | 95,482.00 | |
| | | T 2.375 05/15/51 | 590,000.00 | 431,343.10 | |
| | | T 2.375 11/15/49 | 580,000.00 | 426,555.20 | |
| | | T 2.5 02/15/45 | 220,000.00 | 172,880.40 | |
| | | T 2.5 02/15/46 | 220,000.00 | 171,340.40 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 2.5 03/31/27 | 700,000.00 | 683,970.00 | |
| | | T 2.5 05/15/46 | 230,000.00 | 178,689.30 | |
| | | T 2.625 01/31/26 | 230,000.00 | 226,584.50 | |
| | | T 2.625 05/31/27 | 180,000.00 | 176,160.60 | |
| | | T 2.625 07/31/29 | 220,000.00 | 212,049.20 | |
| | | T 2.625 12/31/25 | 110,000.00 | 108,384.10 | |
| | | T 2.75 02/15/28 | 420,000.00 | 410,726.40 | |
| | | T 2.75 04/30/27 | 1,140,000.00 | 1,119,867.60 | |
| | | T 2.75 05/31/29 | 1,000,000.00 | 970,540.00 | |
| | | T 2.75 07/31/27 | 350,000.00 | 343,395.50 | |
| | | T 2.75 08/15/32 | 980,000.00 | 926,168.60 | |
| | | T 2.75 08/15/42 | 230,000.00 | 193,482.90 | |
| | | T 2.75 08/15/47 | 250,000.00 | 201,225.00 | |
| | | T 2.75 11/15/47 | 250,000.00 | 200,882.50 | |
| | | T 2.875 04/30/29 | 100,000.00 | 97,636.00 | |
| | | T 2.875 05/15/32 | 850,000.00 | 812,294.00 | |
| | | T 2.875 05/15/43 | 290,000.00 | 246,384.00 | |
| | | T 2.875 05/15/49 | 590,000.00 | 481,322.00 | |
| | | T 2.875 05/15/52 | 520,000.00 | 422,385.60 | |
| | | T 2.875 08/15/28 | 300,000.00 | 293,922.00 | |
| | | T 2.875 08/15/45 | 110,000.00 | 91,969.90 | |
| | | T 3 02/15/48 | 360,000.00 | 302,130.00 | |
| | | T 3 02/15/49 | 370,000.00 | 309,209.00 | |
| | | T 3 05/15/45 | 290,000.00 | 247,868.80 | |
| | | T 3 05/15/47 | 300,000.00 | 253,077.00 | |
| | | T 3 08/15/48 | 500,000.00 | 418,580.00 | |
| | | T 3 08/15/52 | 360,000.00 | 300,056.40 | |
| | | T 3 09/30/25 | 620,000.00 | 613,967.40 | |
| | | T 3 11/15/44 | 220,000.00 | 188,460.80 | |
| | | T 3.125 02/15/42 | 150,000.00 | 134,749.50 | |
| | | T 3.125 05/15/48 | 420,000.00 | 360,074.40 | |
| | | T 3.125 08/15/44 | 320,000.00 | 280,073.60 | |
| | | T 3.125 08/31/27 | 430,000.00 | 426,237.50 | |
| | | T 3.125 08/31/29 | 870,000.00 | 857,628.60 | |
| | | T 3.125 11/15/28 | 100,000.00 | 98,791.00 | |
| | | T 3.125 11/15/41 | 210,000.00 | 189,655.20 | |
| | | T 3.25 05/15/42 | 370,000.00 | 336,004.40 | |
| | | T 3.25 06/30/27 | 100,000.00 | 99,500.00 | |
| | | T 3.25 06/30/29 | 660,000.00 | 654,482.40 | |
| | | T 3.375 05/15/33 | 720,000.00 | 708,984.00 | |
| | | T 3.375 05/15/44 | 300,000.00 | 273,105.00 | |
| | | T 3.375 08/15/42 | 330,000.00 | 304,425.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 3.375 11/15/48 | 300,000.00 | 268,164.00 | |
| | | T 3.5 01/31/28 | 980,000.00 | 982,254.00 | |
| | | T 3.5 01/31/30 | 500,000.00 | 501,100.00 | |
| | | T 3.5 02/15/33 | 1,020,000.00 | 1,014,757.20 | |
| | | T 3.5 02/15/39 | 50,000.00 | 48,771.00 | |
| | | T 3.5 04/30/28 | 800,000.00 | 802,104.00 | |
| | | T 3.5 04/30/30 | 500,000.00 | 501,015.00 | |
| | | T 3.625 02/15/44 | 270,000.00 | 255,285.00 | |
| | | T 3.625 02/15/53 | 700,000.00 | 658,735.00 | |
| | | T 3.625 03/31/28 | 730,000.00 | 735,029.70 | |
| | | T 3.625 03/31/30 | 940,000.00 | 947,886.60 | |
| | | T 3.625 05/15/26 | 830,000.00 | 829,593.30 | |
| | | T 3.625 05/15/53 | 530,000.00 | 499,376.60 | |
| | | T 3.625 05/31/28 | 400,000.00 | 402,772.00 | |
| | | T 3.625 08/15/43 | 230,000.00 | 217,987.10 | |
| | | T 3.75 04/15/26 | 440,000.00 | 440,523.60 | |
| | | T 3.75 06/30/30 | 280,000.00 | 284,057.20 | |
| | | T 3.75 08/15/27 | 300,000.00 | 302,541.00 | |
| | | T 3.75 12/31/28 | 800,000.00 | 810,400.00 | |
| | | T 3.75 12/31/30 | 350,000.00 | 355,215.00 | |
| | | T 3.875 01/15/26 | 390,000.00 | 390,514.80 | |
| | | T 3.875 02/15/43 | 450,000.00 | 443,925.00 | |
| | | T 3.875 05/15/43 | 670,000.00 | 659,501.10 | |
| | | T 3.875 08/15/33 | 1,180,000.00 | 1,204,933.40 | |
| | | T 3.875 08/15/34 | 580,000.00 | 592,185.80 | |
| | | T 3.875 08/15/40 | 40,000.00 | 40,351.20 | |
| | | T 3.875 09/30/29 | 200,000.00 | 203,964.00 | |
| | | T 3.875 11/30/27 | 410,000.00 | 415,428.40 | |
| | | T 3.875 11/30/29 | 340,000.00 | 346,810.20 | |
| | | T 3.875 12/31/27 | 260,000.00 | 263,699.80 | |
| | | T 3.875 12/31/29 | 620,000.00 | 632,468.20 | |
| | | T 4 01/15/27 | 1,190,000.00 | 1,203,078.10 | |
| | | T 4 01/31/29 | 890,000.00 | 910,834.90 | |
| | | T 4 01/31/31 | 670,000.00 | 689,497.00 | |
| | | T 4 02/15/26 | 640,000.00 | 642,419.20 | |
| | | T 4 02/15/34 | 1,300,000.00 | 1,339,910.00 | |
| | | T 4 02/28/30 | 770,000.00 | 790,782.30 | |
| | | T 4 02/29/28 | 600,000.00 | 611,154.00 | |
| | | T 4 06/30/28 | 370,000.00 | 377,607.20 | |
| | | T 4 07/31/29 | 700,000.00 | 718,095.00 | |
| | | T 4 10/31/29 | 300,000.00 | 307,698.00 | |
| | | T 4 11/15/42 | 300,000.00 | 301,599.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 4 11/15/52 | 380,000.00 | 381,862.00 | |
| | | T 4 12/15/25 | 300,000.00 | 300,642.00 | |
| | | T 4.125 02/15/27 | 750,000.00 | 760,837.50 | |
| | | T 4.125 03/31/29 | 700,000.00 | 720,587.00 | |
| | | T 4.125 03/31/31 | 700,000.00 | 725,823.00 | |
| | | T 4.125 06/15/26 | 900,000.00 | 907,533.00 | |
| | | T 4.125 07/31/28 | 170,000.00 | 174,289.10 | |
| | | T 4.125 07/31/31 | 600,000.00 | 622,776.00 | |
| | | T 4.125 08/15/53 | 930,000.00 | 957,602.40 | |
| | | T 4.125 09/30/27 | 880,000.00 | 897,820.00 | |
| | | T 4.125 10/31/27 | 470,000.00 | 479,583.30 | |
| | | T 4.125 11/15/32 | 1,010,000.00 | 1,051,046.40 | |
| | | T 4.25 01/31/26 | 580,000.00 | 583,723.60 | |
| | | T 4.25 02/15/54 | 1,290,000.00 | 1,358,524.80 | |
| | | T 4.25 02/28/29 | 600,000.00 | 620,682.00 | |
| | | T 4.25 02/28/31 | 750,000.00 | 782,865.00 | |
| | | T 4.25 03/15/27 | 750,000.00 | 764,047.50 | |
| | | T 4.25 05/15/39 | 70,000.00 | 73,920.70 | |
| | | T 4.25 06/30/29 | 750,000.00 | 777,210.00 | |
| | | T 4.25 06/30/31 | 650,000.00 | 679,549.00 | |
| | | T 4.25 08/15/54 | 500,000.00 | 527,810.00 | |
| | | T 4.25 11/15/40 | 140,000.00 | 147,499.80 | |
| | | T 4.25 12/31/25 | 600,000.00 | 603,246.00 | |
| | | T 4.375 05/15/34 | 1,060,000.00 | 1,124,999.20 | |
| | | T 4.375 05/15/40 | 140,000.00 | 149,780.40 | |
| | | T 4.375 07/15/27 | 600,000.00 | 614,880.00 | |
| | | T 4.375 07/31/26 | 500,000.00 | 507,030.00 | |
| | | T 4.375 08/15/26 | 500,000.00 | 507,410.00 | |
| | | T 4.375 08/15/43 | 600,000.00 | 631,242.00 | |
| | | T 4.375 08/31/28 | 900,000.00 | 931,356.00 | |
| | | T 4.375 11/15/39 | 80,000.00 | 85,548.00 | |
| | | T 4.375 11/30/28 | 400,000.00 | 414,796.00 | |
| | | T 4.375 11/30/30 | 300,000.00 | 314,793.00 | |
| | | T 4.375 12/15/26 | 600,000.00 | 611,118.00 | |
| | | T 4.5 02/15/36 | 50,000.00 | 54,443.00 | |
| | | T 4.5 02/15/44 | 500,000.00 | 533,590.00 | |
| | | T 4.5 03/31/26 | 1,000,000.00 | 1,011,850.00 | |
| | | T 4.5 04/15/27 | 1,200,000.00 | 1,230,276.00 | |
| | | T 4.5 05/15/27 | 800,000.00 | 820,776.00 | |
| | | T 4.5 05/31/29 | 1,170,000.00 | 1,225,025.10 | |
| | | T 4.5 07/15/26 | 750,000.00 | 761,775.00 | |
| | | T 4.5 11/15/25 | 400,000.00 | 402,804.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 4.5 11/15/33 | 960,000.00 | 1,027,123.20 | |
| | | T 4.625 02/15/40 | 100,000.00 | 109,863.00 | |
| | | T 4.625 02/28/26 | 500,000.00 | 506,285.00 | |
| | | T 4.625 03/15/26 | 900,000.00 | 911,898.00 | |
| | | T 4.625 04/30/29 | 900,000.00 | 946,125.00 | |
| | | T 4.625 04/30/31 | 1,200,000.00 | 1,279,776.00 | |
| | | T 4.625 05/15/44 | 700,000.00 | 758,947.00 | |
| | | T 4.625 05/15/54 | 1,300,000.00 | 1,456,598.00 | |
| | | T 4.625 05/31/31 | 600,000.00 | 640,062.00 | |
| | | T 4.625 06/15/27 | 570,000.00 | 587,567.40 | |
| | | T 4.625 06/30/26 | 700,000.00 | 712,054.00 | |
| | | T 4.625 09/15/26 | 900,000.00 | 918,333.00 | |
| | | T 4.625 09/30/28 | 470,000.00 | 491,121.80 | |
| | | T 4.625 09/30/30 | 530,000.00 | 562,886.50 | |
| | | T 4.625 10/15/26 | 900,000.00 | 919,332.00 | |
| | | T 4.625 11/15/26 | 900,000.00 | 920,313.00 | |
| | | T 4.75 11/15/43 | 980,000.00 | 1,081,577.00 | |
| | | T 4.75 11/15/53 | 630,000.00 | 718,565.40 | |
| | | T 4.875 04/30/26 | 1,000,000.00 | 1,018,710.00 | |
| | | T 4.875 05/31/26 | 700,000.00 | 714,000.00 | |
| | | T 4.875 10/31/28 | 900,000.00 | 949,761.00 | |
| | | T 4.875 11/30/25 | 550,000.00 | 556,484.50 | |
| | アメリカ・ドル小計 | | 123,680,000.00 | 119,142,957.40<br>(16,771,754,113) | |
| | カナダ・ドル | CAN 0.25 03/01/26 | 70,000.00 | 67,267.90 | |
| | | CAN 0.5 09/01/25 | 180,000.00 | 175,203.00 | |
| | | CAN 0.5 12/01/30 | 220,000.00 | 192,471.40 | |
| | | CAN 1 06/01/27 | 140,000.00 | 134,138.20 | |
| | | CAN 1.25 03/01/27 | 390,000.00 | 376,217.40 | |
| | | CAN 1.25 06/01/30 | 150,000.00 | 138,556.50 | |
| | | CAN 1.5 06/01/26 | 20,000.00 | 19,538.60 | |
| | | CAN 1.5 06/01/31 | 290,000.00 | 268,145.60 | |
| | | CAN 1.5 12/01/31 | 60,000.00 | 55,107.00 | |
| | | CAN 1.75 12/01/53 | 350,000.00 | 262,076.50 | |
| | | CAN 2 06/01/28 | 60,000.00 | 58,666.20 | |
| | | CAN 2 06/01/32 | 400,000.00 | 378,588.00 | |
| | | CAN 2 12/01/51 | 240,000.00 | 192,945.60 | |
| | | CAN 2.25 06/01/29 | 60,000.00 | 59,125.20 | |
| | | CAN 2.25 12/01/29 | 310,000.00 | 304,227.80 | |
| | | CAN 2.5 12/01/32 | 110,000.00 | 107,682.30 | |
| | | CAN 2.75 06/01/33 | 670,000.00 | 667,112.30 | |
| | | CAN 2.75 09/01/27 | 60,000.00 | 60,075.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | CAN 2.75 12/01/48 | 70,000.00 | 66,431.40 | |
| | CAN 2.75 12/01/55 | 240,000.00 | 225,336.00 | |
| | CAN 3 04/01/26 | 200,000.00 | 199,892.00 | |
| | CAN 3 06/01/34 | 130,000.00 | 131,489.80 | |
| | CAN 3 10/01/25 | 280,000.00 | 279,216.00 | |
| | CAN 3.25 09/01/28 | 460,000.00 | 469,908.40 | |
| | CAN 3.25 12/01/34 | 130,000.00 | 134,056.00 | |
| | CAN 3.5 03/01/28 | 230,000.00 | 236,154.80 | |
| | CAN 3.5 03/01/34 | 220,000.00 | 232,238.60 | |
| | CAN 3.5 09/01/29 | 50,000.00 | 51,900.00 | |
| | CAN 3.5 12/01/45 | 90,000.00 | 96,431.40 | |
| | CAN 4 03/01/29 | 120,000.00 | 126,643.20 | |
| | CAN 4 08/01/26 | 570,000.00 | 581,576.70 | |
| | CAN 4.5 11/01/25 | 250,000.00 | 253,372.50 | |
| | CAN 5 06/01/37 | 210,000.00 | 255,271.80 | |
| | CANADA 2.75 12/01/64 | 120,000.00 | 113,475.60 | |
| カナダ・ドル小計 | | 7,150,000.00 | 6,970,538.70<br>(721,868,988) | |
| オーストラリア・ドル | ACGB 0.25 11/21/25 | 200,000.00 | 192,076.00 | |
| | ACGB 0.5 09/21/26 | 430,000.00 | 405,404.00 | |
| | ACGB 1 11/21/31 | 340,000.00 | 283,322.00 | |
| | ACGB 1 12/21/30 | 710,000.00 | 608,555.20 | |
| | ACGB 1.25 05/21/32 | 400,000.00 | 334,912.00 | |
| | ACGB 1.5 06/21/31 | 190,000.00 | 166,071.40 | |
| | ACGB 1.75 06/21/51 | 230,000.00 | 135,419.40 | |
| | ACGB 1.75 11/21/32 | 200,000.00 | 172,086.00 | |
| | ACGB 2.75 05/21/41 | 240,000.00 | 199,488.00 | |
| | ACGB 2.75 06/21/35 | 50,000.00 | 45,152.50 | |
| | ACGB 2.75 11/21/27 | 220,000.00 | 215,780.40 | |
| | ACGB 2.75 11/21/28 | 440,000.00 | 429,114.40 | |
| | ACGB 2.75 11/21/29 | 200,000.00 | 193,322.00 | |
| | ACGB 3 03/21/47 | 210,000.00 | 170,091.60 | |
| | ACGB 3 11/21/33 | 370,000.00 | 347,411.50 | |
| | ACGB 3.25 04/21/29 | 130,000.00 | 129,061.40 | |
| | ACGB 3.5 12/21/34 | 370,000.00 | 359,584.50 | |
| | ACGB 3.75 04/21/37 | 90,000.00 | 88,475.40 | |
| | ACGB 3.75 05/21/34 | 150,000.00 | 149,265.00 | |
| | ACGB 4.25 04/21/26 | 130,000.00 | 131,424.80 | |
| | ACGB 4.25 06/21/34 | 170,000.00 | 176,060.50 | |
| | ACGB 4.75 04/21/27 | 80,000.00 | 82,636.80 | |
| オーストラリア・ドル小計 | | 5,550,000.00 | 5,014,714.80<br>(475,846,287) | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| シンガポール・ドル | SIGB 0.5 11/01/25 | 40,000.00 | 39,103.60 | |
| | SIGB 1.25 11/01/26 | 100,000.00 | 97,887.00 | |
| | SIGB 1.875 03/01/50 | 140,000.00 | 123,480.00 | |
| | SIGB 1.875 10/01/51 | 30,000.00 | 26,115.00 | |
| | SIGB 2.125 06/01/26 | 190,000.00 | 189,403.40 | |
| | SIGB 2.25 08/01/36 | 250,000.00 | 245,375.00 | |
| | SIGB 2.375 07/01/39 | 170,000.00 | 167,902.20 | |
| | SIGB 2.625 05/01/28 | 200,000.00 | 202,640.00 | |
| | SIGB 2.75 03/01/46 | 40,000.00 | 41,500.40 | |
| | SIGB 2.875 07/01/29 | 150,000.00 | 154,041.00 | |
| | SIGB 2.875 09/01/30 | 480,000.00 | 495,984.00 | |
| | SIGB 3 04/01/29 | 110,000.00 | 113,597.00 | |
| | SIGB 3 08/01/72 | 80,000.00 | 90,662.40 | |
| | SIGB 3.25 06/01/54 | 100,000.00 | 115,325.00 | |
| | SIGB 3.375 09/01/33 | 930,000.00 | 1,002,540.00 | |
| | シンガポール・ドル小計 | 3,010,000.00 | 3,105,556.00<br>(337,232,326) | |
| ニュージーランド・ドル | NZGB 0.25 05/15/28 | 300,000.00 | 265,863.00 | |
| | NZGB 0.5 05/15/26 | 70,000.00 | 66,294.20 | |
| | NZGB 1.75 05/15/41 | 190,000.00 | 128,903.60 | |
| | NZGB 2 05/15/32 | 340,000.00 | 296,265.80 | |
| | NZGB 2.75 04/15/37 | 80,000.00 | 67,850.40 | |
| | NZGB 2.75 05/15/51 | 30,000.00 | 21,564.60 | |
| | NZGB 4.5 04/15/27 | 110,000.00 | 112,370.50 | |
| | NZGB 4.5 05/15/30 | 120,000.00 | 124,484.40 | |
| | NZGB 5 05/15/54 | 50,000.00 | 53,000.50 | |
| | ニュージーランド・ドル小計 | 1,290,000.00 | 1,136,597.00<br>(98,963,501) | |
| イギリス・ポンド | UK TSY GILT 1.125 01/31/39 | 190,000.00 | 130,915.70 | |
| | UKT 0.125 01/30/26 | 320,000.00 | 305,580.80 | |
| | UKT 0.125 01/31/28 | 170,000.00 | 152,289.40 | |
| | UKT 0.25 07/31/31 | 210,000.00 | 168,331.80 | |
| | UKT 0.375 10/22/26 | 270,000.00 | 252,590.40 | |
| | UKT 0.375 10/22/30 | 350,000.00 | 290,755.50 | |
| | UKT 0.5 01/31/29 | 600,000.00 | 527,916.00 | |
| | UKT 0.5 10/22/61 | 360,000.00 | 116,971.20 | |
| | UKT 0.625 07/31/35 | 70,000.00 | 50,428.00 | |
| | UKT 0.625 10/22/50 | 260,000.00 | 112,743.80 | |
| | UKT 0.875 01/31/46 | 550,000.00 | 291,324.00 | |
| | UKT 0.875 10/22/29 | 160,000.00 | 140,867.20 | |
| | UKT 1 01/31/32 | 170,000.00 | 141,720.50 | |
| | UKT 1.125 10/22/73 | 90,000.00 | 35,505.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | UKT 1.25 07/22/27 | 130,000.00 | 122,059.60 | |
| | | UKT 1.25 07/31/51 | 90,000.00 | 46,644.30 | |
| | | UKT 1.25 10/22/41 | 590,000.00 | 383,199.10 | |
| | | UKT 1.5 07/22/26 | 240,000.00 | 230,772.00 | |
| | | UKT 1.5 07/22/47 | 110,000.00 | 65,697.50 | |
| | | UKT 1.5 07/31/53 | 20,000.00 | 10,790.00 | |
| | | UKT 1.625 10/22/28 | 70,000.00 | 65,196.60 | |
| | | UKT 1.625 10/22/54 | 100,000.00 | 55,220.00 | |
| | | UKT 1.625 10/22/71 | 130,000.00 | 63,414.00 | |
| | | UKT 1.75 01/22/49 | 90,000.00 | 55,725.30 | |
| | | UKT 1.75 07/22/57 | 120,000.00 | 67,165.20 | |
| | | UKT 1.75 09/07/37 | 170,000.00 | 133,070.90 | |
| | | UKT 2 09/07/25 | 30,000.00 | 29,407.50 | |
| | | UKT 2.5 07/22/65 | 120,000.00 | 79,746.00 | |
| | | UKT 3.25 01/22/44 | 90,000.00 | 78,255.00 | |
| | | UKT 3.25 01/31/33 | 650,000.00 | 630,506.50 | |
| | | UKT 3.5 01/22/45 | 120,000.00 | 107,640.00 | |
| | | UKT 3.5 07/22/68 | 140,000.00 | 119,490.00 | |
| | | UKT 3.5 10/22/25 | 100,000.00 | 99,271.00 | |
| | | UKT 3.75 01/29/38 | 450,000.00 | 441,283.50 | |
| | | UKT 3.75 03/07/27 | 520,000.00 | 519,833.60 | |
| | | UKT 3.75 07/22/52 | 40,000.00 | 36,308.00 | |
| | | UKT 3.75 10/22/53 | 380,000.00 | 343,352.80 | |
| | | UKT 4 01/22/60 | 110,000.00 | 103,912.60 | |
| | | UKT 4 10/22/63 | 350,000.00 | 329,756.00 | |
| | | UKT 4.125 01/29/27 | 410,000.00 | 413,189.80 | |
| | | UKT 4.125 07/22/29 | 230,000.00 | 235,181.90 | |
| | | UKT 4.25 03/07/36 | 180,000.00 | 186,921.00 | |
| | | UKT 4.25 06/07/32 | 140,000.00 | 146,298.60 | |
| | | UKT 4.25 07/31/34 | 110,000.00 | 114,444.00 | |
| | | UKT 4.25 09/07/39 | 80,000.00 | 81,820.00 | |
| | | UKT 4.25 12/07/27 | 80,000.00 | 81,749.60 | |
| | | UKT 4.25 12/07/49 | 90,000.00 | 89,083.80 | |
| | | UKT 4.375 07/31/54 | 410,000.00 | 411,914.70 | |
| | | UKT 4.5 06/07/28 | 220,000.00 | 226,578.00 | |
| | | UKT 4.5 09/07/34 | 30,000.00 | 31,863.90 | |
| | | UKT 4.5 12/07/42 | 50,000.00 | 51,957.00 | |
| | | UKT 4.625 01/31/34 | 560,000.00 | 599,356.80 | |
| | | UKT 4.75 10/22/43 | 420,000.00 | 448,455.00 | |
| | | UKT 4.75 12/07/30 | 110,000.00 | 117,470.10 | |
| | | UKT 4.75 12/07/38 | 410,000.00 | 443,775.80 | |
| | | UKT 6 12/07/28 | 100,000.00 | 109,875.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| イギリス・ポンド小計 | | 12,360,000.00 | 10,725,591.30<br>(1,993,243,887) | |
| イスラエル・シュケル | ILGOV 0.5 02/27/26 | 290,000.00 | 275,065.00 | |
| | ILGOV 1 03/31/30 | 520,000.00 | 430,107.60 | |
| | ILGOV 1.3 04/30/32 | 500,000.00 | 391,225.00 | |
| | ILGOV 1.5 05/31/37 | 440,000.00 | 295,596.40 | |
| | ILGOV 1.75 08/31/25 | 150,000.00 | 146,694.00 | |
| | ILGOV 2 03/31/27 | 260,000.00 | 245,564.80 | |
| | ILGOV 2.25 09/28/28 | 480,000.00 | 441,110.40 | |
| | ILGOV 2.8 11/29/52 | 220,000.00 | 137,845.40 | |
| | ILGOV 3.75 02/28/29 | 210,000.00 | 203,469.00 | |
| | ILGOV 3.75 03/31/47 | 230,000.00 | 183,339.90 | |
| | ILGOV 6.25 10/30/26 | 110,000.00 | 114,228.40 | |
| イスラエル・シュケル小計 | | 3,410,000.00 | 2,864,245.90<br>(107,550,142) | |
| デンマーク・クローネ | DGB 0 11/15/31 | 770,000.00 | 671,401.50 | |
| | DGB 0.25 11/15/52 | 390,000.00 | 228,594.60 | |
| | DGB 0.5 11/15/27 | 570,000.00 | 545,752.20 | |
| | DGB 0.5 11/15/29 | 820,000.00 | 763,879.20 | |
| | DGB 1.75 11/15/25 | 340,000.00 | 338,096.00 | |
| | DGB 2.25 11/15/33 | 950,000.00 | 965,561.00 | |
| | DGB 4.5 11/15/39 | 910,000.00 | 1,166,729.20 | |
| デンマーク・クローネ小計 | | 4,750,000.00 | 4,680,013.70<br>(98,186,687) | |
| ノルウェー・クローネ | NGB 1.25 09/17/31 | 390,000.00 | 344,584.50 | |
| | NGB 1.375 08/19/30 | 680,000.00 | 617,997.60 | |
| | NGB 1.5 02/19/26 | 370,000.00 | 360,180.20 | |
| | NGB 1.75 02/17/27 | 790,000.00 | 764,546.20 | |
| | NGB 1.75 09/06/29 | 170,000.00 | 159,674.20 | |
| | NGB 2 04/26/28 | 620,000.00 | 597,766.80 | |
| | NGB 2.125 05/18/32 | 200,000.00 | 186,242.00 | |
| | NGB 3 08/15/33 | 810,000.00 | 797,898.60 | |
| | NGB 3.5 10/06/42 | 310,000.00 | 320,391.20 | |
| | NGB 3.625 04/13/34 | 70,000.00 | 72,086.70 | |
| ノルウェー・クローネ小計 | | 4,410,000.00 | 4,221,368.00<br>(56,059,767) | |
| スウェーデン・クローナ | SGB 0.125 05/12/31 | 400,000.00 | 359,884.00 | |
| | SGB 0.75 05/12/28 | 1,060,000.00 | 1,027,383.80 | |
| | SGB 0.75 11/12/29 | 600,000.00 | 572,778.00 | |
| | SGB 1 11/12/26 | 510,000.00 | 502,645.80 | |
| | SGB 1.75 11/11/33 | 710,000.00 | 705,186.20 | |
| | SGB 2.25 06/01/32 | 340,000.00 | 351,169.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | SGB 3.5 03/30/39 | 330,000.00 | 389,149.20 | |
| スウェーデン・クローナ小計 | | 3,950,000.00 | 3,908,196.00<br>(54,011,269) | |
| メキシコ・ペソ | MBONO 5.5 03/04/27 | 3,100,000.00 | 2,852,961.00 | |
| | MBONO 5.75 03/05/26 | 3,300,000.00 | 3,117,774.00 | |
| | MBONO 7 09/03/26 | 1,000,000.00 | 953,830.00 | |
| | MBONO 7.5 05/26/33 | 3,900,000.00 | 3,495,063.00 | |
| | MBONO 7.5 06/03/27 | 2,800,000.00 | 2,689,736.00 | |
| | MBONO 7.75 05/29/31 | 6,700,000.00 | 6,220,213.00 | |
| | MBONO 7.75 11/13/42 | 2,500,000.00 | 2,106,800.00 | |
| | MBONO 7.75 11/23/34 | 920,000.00 | 831,008.40 | |
| | MBONO 8 05/24/35 | 3,500,000.00 | 3,163,440.00 | |
| | MBONO 8 11/07/47 | 3,100,000.00 | 2,651,957.00 | |
| | MBONO 8.5 03/01/29 | 3,300,000.00 | 3,209,844.00 | |
| | MBONO 8.5 05/31/29 | 3,500,000.00 | 3,405,920.00 | |
| | MBONO 8.5 11/18/38 | 1,900,000.00 | 1,760,065.00 | |
| メキシコ・ペソ小計 | | 39,520,000.00 | 36,458,611.40<br>(266,815,056) | |
| オフショア・人民元 | CGB 1.62 08/15/27 | 8,700,000.00 | 8,739,846.00 | |
| | CGB 1.85 05/15/27 | 8,300,000.00 | 8,382,751.00 | |
| | CGB 1.91 07/15/29 | 4,800,000.00 | 4,844,400.00 | |
| | CGB 1.99 03/15/26 | 10,800,000.00 | 10,902,924.00 | |
| | CGB 2.04 02/25/27 | 10,400,000.00 | 10,544,976.00 | |
| | CGB 2.05 04/15/29 | 3,200,000.00 | 3,248,128.00 | |
| | CGB 2.11 08/25/34 | 2,000,000.00 | 2,007,580.00 | |
| | CGB 2.12 06/25/31 | 6,200,000.00 | 6,277,562.00 | |
| | CGB 2.18 08/15/26 | 6,000,000.00 | 6,086,280.00 | |
| | CGB 2.27 05/25/34 | 4,700,000.00 | 4,781,075.00 | |
| | CGB 2.28 03/25/31 | 5,900,000.00 | 6,031,275.00 | |
| | CGB 2.28 11/25/25 | 4,800,000.00 | 4,848,528.00 | |
| | CGB 2.3 05/15/26 | 6,400,000.00 | 6,493,056.00 | |
| | CGB 2.35 02/25/34 | 5,700,000.00 | 5,836,059.00 | |
| | CGB 2.37 01/15/29 | 8,200,000.00 | 8,430,666.00 | |
| | CGB 2.4 07/15/28 | 5,300,000.00 | 5,447,075.00 | |
| | CGB 2.44 10/15/27 | 900,000.00 | 923,958.00 | |
| | CGB 2.46 02/15/26 | 3,600,000.00 | 3,650,004.00 | |
| | CGB 2.48 04/15/27 | 6,800,000.00 | 6,970,068.00 | |
| | CGB 2.48 09/25/28 | 10,200,000.00 | 10,508,754.00 | |
| | CGB 2.6 09/15/30 | 5,400,000.00 | 5,627,016.00 | |
| | CGB 2.62 06/25/30 | 5,400,000.00 | 5,628,096.00 | |
| | CGB 2.64 01/15/28 | 5,400,000.00 | 5,582,250.00 | |
| | CGB 2.67 05/25/33 | 10,500,000.00 | 11,025,525.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | CGB 2.69 08/12/26 | 1,200,000.00 | 1,228,752.00 | |
| | CGB 2.79 12/15/29 | 2,800,000.00 | 2,942,156.00 | |
| | CGB 2.8 03/25/30 | 6,000,000.00 | 6,308,520.00 | |
| | CGB 2.8 11/15/32 | 3,300,000.00 | 3,494,667.00 | |
| | CGB 2.91 10/14/28 | 3,500,000.00 | 3,670,310.00 | |
| | CGB 3 10/15/53 | 4,400,000.00 | 5,120,544.00 | |
| | CGB 3.02 05/27/31 | 2,800,000.00 | 3,000,564.00 | |
| | CGB 3.03 03/11/26 | 1,300,000.00 | 1,331,330.00 | |
| | CGB 3.12 10/25/52 | 3,600,000.00 | 4,255,956.00 | |
| | CGB 3.19 04/15/53 | 5,300,000.00 | 6,360,265.00 | |
| | CGB 3.69 05/17/28 | 2,000,000.00 | 2,161,480.00 | |
| | CGB 3.72 04/12/51 | 3,100,000.00 | 4,009,664.00 | |
| オフショア・人民元小計 | | 188,900,000.00 | 196,702,060.00<br>(3,897,434,947) | |
| ポーランド・ズロチ | POLGB 0 04/25/26 | 400,000.00 | 373,320.00 | |
| | POLGB 0.25 10/25/26 | 520,000.00 | 475,363.20 | |
| | POLGB 1.25 10/25/30 | 820,000.00 | 660,346.00 | |
| | POLGB 1.75 04/25/32 | 270,000.00 | 213,678.00 | |
| | POLGB 2.5 07/25/27 | 240,000.00 | 226,183.20 | |
| | POLGB 2.75 04/25/28 | 50,000.00 | 46,725.50 | |
| | POLGB 2.75 10/25/29 | 380,000.00 | 343,417.40 | |
| | POLGB 3.75 05/25/27 | 680,000.00 | 663,761.60 | |
| | POLGB 4.75 07/25/29 | 930,000.00 | 921,723.00 | |
| | POLGB 5 10/25/34 | 140,000.00 | 137,275.60 | |
| | POLGB 6 10/25/33 | 280,000.00 | 296,226.00 | |
| | POLGB 7.5 07/25/28 | 690,000.00 | 753,369.60 | |
| ポーランド・ズロチ小計 | | 5,400,000.00 | 5,111,389.10<br>(187,060,485) | |
| ユーロ | BGB 0 10/22/27 | 150,000.00 | 139,989.00 | |
| | BGB 0 10/22/31 | 10,000.00 | 8,408.00 | |
| | BGB 0.1 06/22/30 | 370,000.00 | 324,926.60 | |
| | BGB 0.35 06/22/32 | 150,000.00 | 126,973.50 | |
| | BGB 0.4 06/22/40 | 390,000.00 | 261,385.80 | |
| | BGB 0.65 06/22/71 | 30,000.00 | 13,200.60 | |
| | BGB 0.8 06/22/27 | 270,000.00 | 259,650.90 | |
| | BGB 0.8 06/22/28 | 280,000.00 | 265,596.80 | |
| | BGB 0.9 06/22/29 | 220,000.00 | 206,175.20 | |
| | BGB 1 06/22/26 | 40,000.00 | 39,100.40 | |
| | BGB 1.25 04/22/33 | 50,000.00 | 45,083.50 | |
| | BGB 1.4 06/22/53 | 200,000.00 | 130,658.00 | |
| | BGB 1.45 06/22/37 | 20,000.00 | 16,936.60 | |
| | BGB 1.6 06/22/47 | 100,000.00 | 74,341.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | BGB 1.7 06/22/50 | 30,000.00 | 21,972.60 | |
| | | BGB 1.9 06/22/38 | 60,000.00 | 52,875.60 | |
| | | BGB 2.75 04/22/39 | 320,000.00 | 311,558.40 | |
| | | BGB 2.85 10/22/34 | 50,000.00 | 50,606.50 | |
| | | BGB 3 06/22/33 | 240,000.00 | 247,399.20 | |
| | | BGB 3 06/22/34 | 140,000.00 | 144,092.20 | |
| | | BGB 3.45 06/22/43 | 430,000.00 | 448,296.50 | |
| | | BGB 3.5 06/22/55 | 50,000.00 | 51,341.00 | |
| | | BGB 3.75 06/22/45 | 100,000.00 | 108,655.00 | |
| | | BGB 4 03/28/32 | 130,000.00 | 142,933.70 | |
| | | BGB 4.5 03/28/26 | 150,000.00 | 154,654.50 | |
| | | BGB 5.5 03/28/28 | 80,000.00 | 88,688.80 | |
| | | BKO 2.5 03/19/26 | 400,000.00 | 400,968.00 | |
| | | BKO 2.7 09/17/26 | 470,000.00 | 474,685.90 | |
| | | BKO 2.9 06/18/26 | 380,000.00 | 384,199.00 | |
| | | BKO 3.1 09/18/25 | 140,000.00 | 140,659.40 | |
| | | BTPS 0 04/01/26 | 60,000.00 | 57,682.20 | |
| | | BTPS 0 08/01/26 | 200,000.00 | 190,834.00 | |
| | | BTPS 0.25 03/15/28 | 180,000.00 | 165,996.00 | |
| | | BTPS 0.45 02/15/29 | 170,000.00 | 154,139.00 | |
| | | BTPS 0.5 02/01/26 | 260,000.00 | 252,556.20 | |
| | | BTPS 0.6 08/01/31 | 50,000.00 | 42,561.00 | |
| | | BTPS 0.85 01/15/27 | 120,000.00 | 115,608.00 | |
| | | BTPS 0.9 04/01/31 | 260,000.00 | 227,996.60 | |
| | | BTPS 0.95 06/01/32 | 330,000.00 | 281,625.30 | |
| | | BTPS 0.95 08/01/30 | 520,000.00 | 465,192.00 | |
| | | BTPS 0.95 09/15/27 | 210,000.00 | 200,529.00 | |
| | | BTPS 0.95 12/01/31 | 100,000.00 | 86,510.00 | |
| | | BTPS 1.1 04/01/27 | 130,000.00 | 125,529.30 | |
| | | BTPS 1.35 04/01/30 | 170,000.00 | 156,993.30 | |
| | | BTPS 1.45 03/01/36 | 20,000.00 | 16,159.00 | |
| | | BTPS 1.5 04/30/45 | 130,000.00 | 86,876.40 | |
| | | BTPS 1.6 06/01/26 | 130,000.00 | 127,996.70 | |
| | | BTPS 1.65 03/01/32 | 20,000.00 | 18,132.00 | |
| | | BTPS 1.8 03/01/41 | 120,000.00 | 90,703.20 | |
| | | BTPS 2 02/01/28 | 190,000.00 | 186,542.00 | |
| | | BTPS 2 12/01/25 | 220,000.00 | 218,286.20 | |
| | | BTPS 2.05 08/01/27 | 160,000.00 | 157,945.60 | |
| | | BTPS 2.1 07/15/26 | 150,000.00 | 148,872.00 | |
| | | BTPS 2.15 03/01/72 | 140,000.00 | 88,499.60 | |
| | | BTPS 2.15 09/01/52 | 100,000.00 | 69,427.00 | |
| | | BTPS 2.25 09/01/36 | 170,000.00 | 149,054.30 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | BTPS 2.45 09/01/50 | 280,000.00 | 211,806.00 | |
| | | BTPS 2.5 11/15/25 | 20,000.00 | 19,963.80 | |
| | | BTPS 2.5 12/01/32 | 290,000.00 | 276,341.00 | |
| | | BTPS 2.65 12/01/27 | 270,000.00 | 270,839.70 | |
| | | BTPS 2.7 03/01/47 | 150,000.00 | 122,976.00 | |
| | | BTPS 2.8 03/01/67 | 90,000.00 | 68,593.50 | |
| | | BTPS 2.8 06/15/29 | 250,000.00 | 250,360.00 | |
| | | BTPS 2.8 12/01/28 | 20,000.00 | 20,116.60 | |
| | | BTPS 2.95 02/15/27 | 530,000.00 | 534,944.90 | |
| | | BTPS 2.95 09/01/38 | 200,000.00 | 184,082.00 | |
| | | BTPS 3 08/01/29 | 120,000.00 | 121,294.80 | |
| | | BTPS 3.1 03/01/40 | 220,000.00 | 202,587.00 | |
| | | BTPS 3.1 08/28/26 | 390,000.00 | 393,701.10 | |
| | | BTPS 3.25 03/01/38 | 350,000.00 | 334,085.50 | |
| | | BTPS 3.25 09/01/46 | 90,000.00 | 81,190.80 | |
| | | BTPS 3.35 07/01/29 | 430,000.00 | 440,492.00 | |
| | | BTPS 3.4 04/01/28 | 420,000.00 | 430,852.80 | |
| | | BTPS 3.45 03/01/48 | 10,000.00 | 9,239.90 | |
| | | BTPS 3.45 07/15/27 | 400,000.00 | 409,476.00 | |
| | | BTPS 3.45 07/15/31 | 490,000.00 | 501,539.50 | |
| | | BTPS 3.5 01/15/26 | 80,000.00 | 80,814.40 | |
| | | BTPS 3.5 02/15/31 | 170,000.00 | 174,715.80 | |
| | | BTPS 3.6 09/29/25 | 220,000.00 | 221,676.40 | |
| | | BTPS 3.7 06/15/30 | 270,000.00 | 280,891.80 | |
| | | BTPS 3.8 04/15/26 | 510,000.00 | 519,159.60 | |
| | | BTPS 3.85 02/01/35 | 150,000.00 | 155,175.00 | |
| | | BTPS 3.85 07/01/34 | 510,000.00 | 529,808.40 | |
| | | BTPS 3.85 09/01/49 | 10,000.00 | 9,782.50 | |
| | | BTPS 3.85 12/15/29 | 410,000.00 | 430,032.60 | |
| | | BTPS 4 04/30/35 | 30,000.00 | 31,608.60 | |
| | | BTPS 4 10/30/31 | 120,000.00 | 127,473.60 | |
| | | BTPS 4.05 10/30/37 | 350,000.00 | 365,393.00 | |
| | | BTPS 4.1 02/01/29 | 340,000.00 | 358,856.40 | |
| | | BTPS 4.15 10/01/39 | 400,000.00 | 416,640.00 | |
| | | BTPS 4.2 03/01/34 | 200,000.00 | 213,900.00 | |
| | | BTPS 4.4 05/01/33 | 360,000.00 | 391,878.00 | |
| | | BTPS 4.45 09/01/43 | 630,000.00 | 672,890.40 | |
| | | BTPS 4.5 03/01/26 | 130,000.00 | 133,420.30 | |
| | | BTPS 4.5 10/01/53 | 200,000.00 | 213,816.00 | |
| | | BTPS 4.75 09/01/28 | 200,000.00 | 215,486.00 | |
| | | BTPS 5 08/01/34 | 170,000.00 | 193,296.80 | |
| | | BTPS 5 08/01/39 | 220,000.00 | 250,760.40 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | BTPS 5 09/01/40 | 180,000.00 | 204,899.40 | |
| | | BTPS 5.25 11/01/29 | 250,000.00 | 279,372.50 | |
| | | BTPS 5.75 02/01/33 | 310,000.00 | 367,036.90 | |
| | | BTPS 6 05/01/31 | 130,000.00 | 153,543.00 | |
| | | BTPS 6.5 11/01/27 | 190,000.00 | 212,547.30 | |
| | | DBR 0 02/15/30 | 290,000.00 | 261,475.60 | |
| | | DBR 0 02/15/31 | 350,000.00 | 309,386.00 | |
| | | DBR 0 02/15/32 | 290,000.00 | 250,855.80 | |
| | | DBR 0 05/15/35 | 140,000.00 | 111,431.60 | |
| | | DBR 0 05/15/36 | 230,000.00 | 177,971.70 | |
| | | DBR 0 08/15/26 | 220,000.00 | 211,442.00 | |
| | | DBR 0 08/15/29 | 250,000.00 | 227,510.00 | |
| | | DBR 0 08/15/30 | 260,000.00 | 232,224.20 | |
| | | DBR 0 08/15/30 | 110,000.00 | 98,264.10 | |
| | | DBR 0 08/15/31 | 200,000.00 | 174,944.00 | |
| | | DBR 0 08/15/31 | 210,000.00 | 183,733.20 | |
| | | DBR 0 08/15/50 | 100,000.00 | 54,436.00 | |
| | | DBR 0 08/15/50 | 300,000.00 | 163,593.00 | |
| | | DBR 0 08/15/52 | 140,000.00 | 72,903.60 | |
| | | DBR 0 11/15/27 | 220,000.00 | 206,780.20 | |
| | | DBR 0 11/15/28 | 310,000.00 | 286,328.40 | |
| | | DBR 0.25 02/15/29 | 160,000.00 | 148,779.20 | |
| | | DBR 0.25 08/15/28 | 100,000.00 | 93,751.00 | |
| | | DBR 0.5 02/15/26 | 100,000.00 | 97,537.00 | |
| | | DBR 0.5 02/15/28 | 100,000.00 | 95,310.00 | |
| | | DBR 1 05/15/38 | 700,000.00 | 593,145.00 | |
| | | DBR 1.25 08/15/48 | 120,000.00 | 94,988.40 | |
| | | DBR 1.7 08/15/32 | 180,000.00 | 176,099.40 | |
| | | DBR 1.8 08/15/53 | 390,000.00 | 341,928.60 | |
| | | DBR 1.8 08/15/53 | 150,000.00 | 131,731.50 | |
| | | DBR 2.1 11/15/29 | 220,000.00 | 221,058.20 | |
| | | DBR 2.2 02/15/34 | 480,000.00 | 484,459.20 | |
| | | DBR 2.3 02/15/33 | 390,000.00 | 397,932.60 | |
| | | DBR 2.3 02/15/33 | 260,000.00 | 265,410.60 | |
| | | DBR 2.4 11/15/30 | 250,000.00 | 255,562.50 | |
| | | DBR 2.5 07/04/44 | 330,000.00 | 334,197.60 | |
| | | DBR 2.5 08/15/46 | 230,000.00 | 233,070.50 | |
| | | DBR 2.5 08/15/54 | 370,000.00 | 377,929.10 | |
| | | DBR 2.6 05/15/41 | 380,000.00 | 390,358.80 | |
| | | DBR 2.6 08/15/33 | 250,000.00 | 260,962.50 | |
| | | DBR 2.6 08/15/34 | 170,000.00 | 177,204.60 | |
| | | DBR 4 01/04/37 | 140,000.00 | 165,839.80 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | DBR 4.25 07/04/39 | 90,000.00 | 111,119.40 | |
| | | DBR 4.75 07/04/28 | 170,000.00 | 187,044.20 | |
| | | DBR 4.75 07/04/40 | 130,000.00 | 170,419.60 | |
| | | DBR 5.625 01/04/28 | 160,000.00 | 178,340.80 | |
| | | DBR 6.25 01/04/30 | 130,000.00 | 157,467.70 | |
| | | DBR 6.5 07/04/27 | 90,000.00 | 100,755.90 | |
| | | FRANCE O.A.T. 0.75 05/25/53 | 450,000.00 | 237,595.50 | |
| | | FRTR 0 02/25/26 | 310,000.00 | 299,360.80 | |
| | | FRTR 0 02/25/27 | 900,000.00 | 850,104.00 | |
| | | FRTR 0 05/25/32 | 890,000.00 | 729,737.70 | |
| | | FRTR 0 11/25/29 | 540,000.00 | 476,058.60 | |
| | | FRTR 0 11/25/30 | 1,130,000.00 | 969,325.30 | |
| | | FRTR 0 11/25/31 | 630,000.00 | 524,808.90 | |
| | | FRTR 0.25 11/25/26 | 650,000.00 | 620,977.50 | |
| | | FRTR 0.5 05/25/26 | 270,000.00 | 261,581.40 | |
| | | FRTR 0.5 05/25/29 | 400,000.00 | 365,908.00 | |
| | | FRTR 0.5 05/25/40 | 640,000.00 | 433,414.40 | |
| | | FRTR 0.5 05/25/72 | 80,000.00 | 30,597.60 | |
| | | FRTR 0.5 06/25/44 | 300,000.00 | 182,409.00 | |
| | | FRTR 0.75 02/25/28 | 950,000.00 | 899,479.00 | |
| | | FRTR 0.75 05/25/28 | 390,000.00 | 367,770.00 | |
| | | FRTR 0.75 05/25/52 | 180,000.00 | 97,437.60 | |
| | | FRTR 0.75 11/25/28 | 370,000.00 | 345,794.60 | |
| | | FRTR 1 05/25/27 | 320,000.00 | 308,809.60 | |
| | | FRTR 1 11/25/25 | 200,000.00 | 196,342.00 | |
| | | FRTR 1.25 05/25/34 | 110,000.00 | 95,871.60 | |
| | | FRTR 1.25 05/25/36 | 270,000.00 | 225,558.00 | |
| | | FRTR 1.25 05/25/38 | 460,000.00 | 367,535.40 | |
| | | FRTR 1.5 05/25/50 | 230,000.00 | 158,727.60 | |
| | | FRTR 1.75 05/25/66 | 120,000.00 | 78,997.20 | |
| | | FRTR 1.75 06/25/39 | 160,000.00 | 135,356.80 | |
| | | FRTR 2 11/25/32 | 530,000.00 | 504,374.50 | |
| | | FRTR 2.5 05/25/30 | 210,000.00 | 210,153.30 | |
| | | FRTR 2.5 05/25/43 | 940,000.00 | 844,326.80 | |
| | | FRTR 2.5 09/24/26 | 820,000.00 | 821,795.80 | |
| | | FRTR 2.5 09/24/27 | 150,000.00 | 150,531.00 | |
| | | FRTR 2.75 02/25/29 | 920,000.00 | 931,398.80 | |
| | | FRTR 2.75 02/25/30 | 450,000.00 | 455,224.50 | |
| | | FRTR 2.75 10/25/27 | 470,000.00 | 475,287.50 | |
| | | FRTR 3 05/25/33 | 500,000.00 | 511,295.00 | |
| | | FRTR 3 05/25/54 | 140,000.00 | 129,861.20 | |
| | | FRTR 3 06/25/49 | 380,000.00 | 361,695.40 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | FRTR 3.25 05/25/45 | 280,000.00 | 280,366.80 | |
| | | FRTR 3.25 05/25/55 | 390,000.00 | 377,796.90 | |
| | | FRTR 3.5 04/25/26 | 240,000.00 | 243,952.80 | |
| | | FRTR 3.5 11/25/33 | 590,000.00 | 625,801.20 | |
| | | FRTR 4 04/25/60 | 60,000.00 | 67,523.40 | |
| | | FRTR 4 10/25/38 | 210,000.00 | 232,719.90 | |
| | | FRTR 4.5 04/25/41 | 280,000.00 | 328,750.80 | |
| | | FRTR 4.75 04/25/35 | 100,000.00 | 117,269.00 | |
| | | FRTR 5.5 04/25/29 | 340,000.00 | 384,251.00 | |
| | | FRTR 5.75 10/25/32 | 140,000.00 | 171,173.80 | |
| | | FRTR 6 10/25/25 | 180,000.00 | 186,492.60 | |
| | | IRISH 0 10/18/31 | 50,000.00 | 42,540.50 | |
| | | IRISH 0.2 05/15/27 | 100,000.00 | 95,015.00 | |
| | | IRISH 0.2 10/18/30 | 120,000.00 | 106,312.80 | |
| | | IRISH 0.35 10/18/32 | 160,000.00 | 136,646.40 | |
| | | IRISH 0.9 05/15/28 | 170,000.00 | 162,673.00 | |
| | | IRISH 1 05/15/26 | 30,000.00 | 29,358.60 | |
| | | IRISH 1.1 05/15/29 | 50,000.00 | 47,578.50 | |
| | | IRISH 1.35 03/18/31 | 40,000.00 | 37,789.60 | |
| | | IRISH 1.5 05/15/50 | 100,000.00 | 76,083.00 | |
| | | IRISH 1.7 05/15/37 | 60,000.00 | 53,830.80 | |
| | | IRISH 2.4 05/15/30 | 80,000.00 | 80,630.40 | |
| | | IRISH 2.6 10/18/34 | 50,000.00 | 50,456.50 | |
| | | IRISH 3 10/18/43 | 120,000.00 | 123,705.60 | |
| | | IRISH GOVT 0.55 04/22/41 | 60,000.00 | 42,515.40 | |
| | | NETHER 0 01/15/26 | 100,000.00 | 96,940.00 | |
| | | NETHER 0 01/15/27 | 260,000.00 | 247,613.60 | |
| | | NETHER 0 01/15/29 | 330,000.00 | 300,864.30 | |
| | | NETHER 0 01/15/38 | 220,000.00 | 156,450.80 | |
| | | NETHER 0 01/15/52 | 80,000.00 | 40,334.40 | |
| | | NETHER 0 07/15/30 | 340,000.00 | 299,461.80 | |
| | | NETHER 0.25 07/15/29 | 60,000.00 | 54,790.80 | |
| | | NETHER 0.5 01/15/40 | 340,000.00 | 250,892.80 | |
| | | NETHER 0.5 07/15/26 | 100,000.00 | 97,010.00 | |
| | | NETHER 0.5 07/15/32 | 40,000.00 | 34,928.00 | |
| | | NETHER 0.75 07/15/27 | 190,000.00 | 182,979.50 | |
| | | NETHER 0.75 07/15/28 | 150,000.00 | 142,419.00 | |
| | | NETHER 2 01/15/54 | 140,000.00 | 122,617.60 | |
| | | NETHER 2.5 01/15/33 | 100,000.00 | 101,325.00 | |
| | | NETHER 2.5 07/15/33 | 380,000.00 | 384,385.20 | |
| | | NETHER 2.5 07/15/34 | 70,000.00 | 70,557.90 | |
| | | NETHER 2.75 01/15/47 | 80,000.00 | 81,850.40 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| NETHER 3.25 01/15/44 | 290,000.00 | 316,883.00 | |
| NETHER 4 01/15/37 | 110,000.00 | 126,965.30 | |
| OBL 0 04/10/26 | 570,000.00 | 550,756.80 | |
| OBL 0 04/16/27 | 360,000.00 | 341,834.40 | |
| OBL 0 10/09/26 | 410,000.00 | 392,771.80 | |
| OBL 0 10/10/25 | 100,000.00 | 97,432.00 | |
| OBL 1.3 10/15/27 | 270,000.00 | 264,643.20 | |
| OBL 1.3 10/15/27 | 70,000.00 | 68,615.40 | |
| OBL 2.1 04/12/29 | 130,000.00 | 130,565.50 | |
| OBL 2.1 04/12/29 | 380,000.00 | 381,805.00 | |
| OBL 2.2 04/13/28 | 350,000.00 | 352,485.00 | |
| OBL 2.4 10/19/28 | 350,000.00 | 355,488.00 | |
| OBL 2.5 10/11/29 | 300,000.00 | 307,233.00 | |
| RAGB 0 02/20/30 | 70,000.00 | 61,576.90 | |
| RAGB 0 02/20/31 | 170,000.00 | 145,446.90 | |
| RAGB 0 10/20/28 | 190,000.00 | 173,109.00 | |
| RAGB 0 10/20/40 | 260,000.00 | 163,992.40 | |
| RAGB 0.25 10/20/36 | 60,000.00 | 44,550.60 | |
| RAGB 0.5 02/20/29 | 110,000.00 | 101,764.30 | |
| RAGB 0.5 04/20/27 | 230,000.00 | 220,034.10 | |
| RAGB 0.7 04/20/71 | 70,000.00 | 33,426.40 | |
| RAGB 0.75 02/20/28 | 80,000.00 | 76,049.60 | |
| RAGB 0.75 03/20/51 | 130,000.00 | 78,429.00 | |
| RAGB 0.75 10/20/26 | 60,000.00 | 58,145.40 | |
| RAGB 0.9 02/20/32 | 100,000.00 | 89,252.00 | |
| RAGB 1.5 11/02/86 | 20,000.00 | 12,580.80 | |
| RAGB 1.85 05/23/49 | 190,000.00 | 153,292.00 | |
| RAGB 2.9 02/20/33 | 180,000.00 | 184,339.80 | |
| RAGB 2.9 02/20/34 | 370,000.00 | 378,558.10 | |
| RAGB 3.15 06/20/44 | 50,000.00 | 51,395.50 | |
| RAGB 3.15 10/20/53 | 50,000.00 | 51,362.50 | |
| RAGB 3.2 07/15/39 | 80,000.00 | 83,028.00 | |
| RAGB 3.45 10/20/30 | 140,000.00 | 148,065.40 | |
| RAGB 3.8 01/26/62 | 20,000.00 | 23,705.00 | |
| RAGB 4.15 03/15/37 | 90,000.00 | 102,744.00 | |
| RAGB 4.85 03/15/26 | 150,000.00 | 155,163.00 | |
| RAGB 6.25 07/15/27 | 80,000.00 | 88,674.40 | |
| RFGB 0 09/15/26 | 120,000.00 | 114,651.60 | |
| RFGB 0 09/15/30 | 50,000.00 | 43,354.00 | |
| RFGB 0.125 04/15/36 | 40,000.00 | 29,655.20 | |
| RFGB 0.125 04/15/52 | 60,000.00 | 29,244.00 | |
| RFGB 0.125 09/15/31 | 40,000.00 | 34,057.60 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | RFGB 0.25 09/15/40 | 70,000.00 | 46,546.50 | |
| | | RFGB 0.5 04/15/26 | 70,000.00 | 68,017.60 | |
| | | RFGB 0.5 04/15/43 | 10,000.00 | 6,563.30 | |
| | | RFGB 0.5 09/15/28 | 160,000.00 | 149,200.00 | |
| | | RFGB 0.5 09/15/29 | 50,000.00 | 45,662.00 | |
| | | RFGB 0.75 04/15/31 | 60,000.00 | 53,895.60 | |
| | | RFGB 1.125 04/15/34 | 100,000.00 | 87,534.00 | |
| | | RFGB 1.375 04/15/47 | 10,000.00 | 7,492.70 | |
| | | RFGB 1.5 09/15/32 | 260,000.00 | 240,929.00 | |
| | | RFGB 2.625 07/04/42 | 10,000.00 | 9,619.70 | |
| | | RFGB 2.75 04/15/38 | 100,000.00 | 98,884.00 | |
| | | RFGB 2.95 04/15/55 | 30,000.00 | 29,971.80 | |
| | | RFGB 3 09/15/34 | 70,000.00 | 72,125.90 | |
| | | SPGB 0 01/31/26 | 300,000.00 | 289,755.00 | |
| | | SPGB 0 01/31/27 | 440,000.00 | 416,015.60 | |
| | | SPGB 0 01/31/28 | 450,000.00 | 415,728.00 | |
| | | SPGB 0.1 04/30/31 | 310,000.00 | 263,887.50 | |
| | | SPGB 0.5 04/30/30 | 510,000.00 | 457,470.00 | |
| | | SPGB 0.5 10/31/31 | 200,000.00 | 172,870.00 | |
| | | SPGB 0.6 10/31/29 | 100,000.00 | 91,146.00 | |
| | | SPGB 0.7 04/30/32 | 540,000.00 | 468,045.00 | |
| | | SPGB 0.8 07/30/27 | 300,000.00 | 287,190.00 | |
| | | SPGB 0.8 07/30/29 | 100,000.00 | 92,449.00 | |
| | | SPGB 0.85 07/30/37 | 500,000.00 | 379,395.00 | |
| | | SPGB 1 07/30/42 | 370,000.00 | 253,949.50 | |
| | | SPGB 1 10/31/50 | 40,000.00 | 23,073.20 | |
| | | SPGB 1.2 10/31/40 | 400,000.00 | 294,588.00 | |
| | | SPGB 1.25 10/31/30 | 170,000.00 | 157,693.70 | |
| | | SPGB 1.4 04/30/28 | 370,000.00 | 357,675.30 | |
| | | SPGB 1.4 07/30/28 | 440,000.00 | 424,221.60 | |
| | | SPGB 1.45 04/30/29 | 420,000.00 | 402,309.60 | |
| | | SPGB 1.45 10/31/27 | 180,000.00 | 175,132.80 | |
| | | SPGB 1.45 10/31/71 | 140,000.00 | 73,336.20 | |
| | | SPGB 1.5 04/30/27 | 190,000.00 | 185,907.40 | |
| | | SPGB 1.85 07/30/35 | 20,000.00 | 17,964.60 | |
| | | SPGB 1.9 10/31/52 | 210,000.00 | 148,551.90 | |
| | | SPGB 1.95 04/30/26 | 180,000.00 | 178,592.40 | |
| | | SPGB 1.95 07/30/30 | 210,000.00 | 203,735.70 | |
| | | SPGB 2.35 07/30/33 | 100,000.00 | 96,664.00 | |
| | | SPGB 2.5 05/31/27 | 790,000.00 | 792,125.10 | |
| | | SPGB 2.55 10/31/32 | 110,000.00 | 108,730.60 | |
| | | SPGB 2.8 05/31/26 | 320,000.00 | 321,686.40 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | SPGB 3.15 04/30/33 | 200,000.00 | 205,846.00 | |
| | | SPGB 3.25 04/30/34 | 300,000.00 | 309,450.00 | |
| | | SPGB 3.45 07/30/43 | 270,000.00 | 269,900.10 | |
| | | SPGB 3.45 07/30/66 | 130,000.00 | 124,282.60 | |
| | | SPGB 3.45 10/31/34 | 150,000.00 | 156,910.50 | |
| | | SPGB 3.5 05/31/29 | 340,000.00 | 355,561.80 | |
| | | SPGB 3.55 10/31/33 | 260,000.00 | 275,043.60 | |
| | | SPGB 3.9 07/30/39 | 560,000.00 | 600,667.20 | |
| | | SPGB 4 10/31/54 | 250,000.00 | 265,695.00 | |
| | | SPGB 4.2 01/31/37 | 130,000.00 | 144,947.40 | |
| | | SPGB 4.7 07/30/41 | 50,000.00 | 58,747.00 | |
| | | SPGB 5.75 07/30/32 | 70,000.00 | 85,155.70 | |
| | | SPGB 6 01/31/29 | 70,000.00 | 80,361.40 | |
| | ユーロ小計 | | 73,960,000.00 | 69,811,481.90<br>(10,928,987,491) | |
| 国債証券合計 | | | | 35,995,014,946<br>(35,995,014,946) | |
| 合　計 | | | | 35,995,014,946<br>(35,995,014,946) | |

（注）金額欄の(　)内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

| 通　貨 | 銘柄数 | | 組入債券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 国債証券 | 233 銘柄 | 44.6% | 46.6% |
| カナダ・ドル | 国債証券 | 34 銘柄 | 1.9% | 2.0% |
| オーストラリア・ドル | 国債証券 | 22 銘柄 | 1.3% | 1.3% |
| シンガポール・ドル | 国債証券 | 15 銘柄 | 0.9% | 0.9% |
| ニュージーランド・ドル | 国債証券 | 9 銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| イギリス・ポンド | 国債証券 | 56 銘柄 | 5.3% | 5.5% |
| イスラエル・シュケル | 国債証券 | 11 銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| デンマーク・クローネ | 国債証券 | 7 銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| ノルウェー・クローネ | 国債証券 | 10 銘柄 | 0.1% | 0.2% |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券 | 7 銘柄 | 0.1% | 0.2% |
| メキシコ・ペソ | 国債証券 | 13 銘柄 | 0.7% | 0.7% |
| オフショア・人民元 | 国債証券 | 36 銘柄 | 10.4% | 10.8% |
| ポーランド・ズロチ | 国債証券 | 12 銘柄 | 0.5% | 0.5% |
| ユーロ | 国債証券 | 321 銘柄 | 29.1% | 30.4% |

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【中間財務諸表】

１．当ファンドの中間財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）ならびに同規則第 284 条、第 307 条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

２．当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 8 期中間計算期間（2024 年 9 月 18 日から 2025 年 3 月 17 日まで）の中間財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人により中間監査を受けております。

# 独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2025年5月28日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2024年9月18日から2025年3月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2025年3月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年9月18日から2025年3月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の

意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

---

（注）1. 上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
2. XBRL データは中間監査の対象には含まれていません。

【三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型)】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 第７期<br>(2024年 9月 17日現在) | 第８期中間計算期間<br>(2025年 3月 17日現在) |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 18,185,201 | 22,527,961 |
| 金銭信託 | 1,653,096 | 1,170,619 |
| コール・ローン | 164,357,040 | 186,368,424 |
| 投資証券 | 114,537,710 | 117,352,528 |
| 親投資信託受益証券 | 12,624,151,989 | 13,460,802,700 |
| 未収入金 | 28,000,000 | － |
| 流動資産合計 | 12,950,885,036 | 13,788,222,232 |
| 資産合計 | 12,950,885,036 | 13,788,222,232 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 39,958,473 | 22,555,443 |
| 未払受託者報酬 | 2,063,353 | 2,201,911 |
| 未払委託者報酬 | 58,463,193 | 62,388,769 |
| その他未払費用 | 412,622 | 330,205 |
| 流動負債合計 | 100,897,641 | 87,476,328 |
| 負債合計 | 100,897,641 | 87,476,328 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 12,207,789,370 | 13,197,049,693 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 642,198,025 | 503,696,211 |
| （分配準備積立金） | 429,921,745 | 400,365,498 |
| 元本等合計 | 12,849,987,395 | 13,700,745,904 |
| 純資産合計 | 12,849,987,395 | 13,700,745,904 |
| 負債純資産合計 | 12,950,885,036 | 13,788,222,232 |

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第７期中間計算期間<br>自　2023年 9月 16日<br>至　2024年 3月 15日 | 第８期中間計算期間<br>自　2024年 9月 18日<br>至　2025年 3月 17日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 4,847,099 | 3,150,548 |
| 受取利息 | 93,883 | 363,750 |
| 有価証券売買等損益 | 307,922,007 | △141,100,638 |
| 為替差損益 | 1,369,010 | 7,608,680 |
| 営業収益合計 | 314,231,999 | △129,977,660 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 16,390 | － |
| 受託者報酬 | 1,809,616 | 2,201,911 |
| 委託者報酬 | 51,273,647 | 62,388,769 |
| その他費用 | 387,604 | 352,175 |
| 営業費用合計 | 53,487,257 | 64,942,855 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 260,744,742 | △194,920,515 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 260,744,742 | △194,920,515 |
| 中間純利益又は中間純損失（△） | 260,744,742 | △194,920,515 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△） | 7,171,332 | 6,467,382 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 281,148,339 | 642,198,025 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 57,897,941 | 111,007,448 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | － | － |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 57,897,941 | 111,007,448 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 25,118,975 | 48,121,365 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 25,118,975 | 48,121,365 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | － | － |
| 分配金 | － | － |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 567,500,715 | 503,696,211 |

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 第８期中間計算期間<br>自 2024年９月18日<br>至 2025年３月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　その他中間財務諸表作成のための重要な事項 | (1) 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。<br>(2) 中間計算期間の取扱い<br>当中間計算期間は前期末が休日のため、2024年９月18日から2025年３月17日までとなっております。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | 第７期<br>（2024年９月17日現在） | 第８期中間計算期間<br>（2025年３月17日現在） |
|---|---|---|
| １．　当中間計算期間の末日における受益権の総数 | 12,207,789,370口 | 13,197,049,693口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　1.0526円<br>（１万口当たりの純資産額10,526円） | １口当たり純資産額　1.0382円<br>（１万口当たりの純資産額10,382円） |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | 第８期中間計算期間<br>（2025年３月17日現在） |
|---|---|
| １．　中間貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |

| | |
|---|---|
| ２．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| ３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

| 項　目 | 第７期<br>(2024年９月17日現在) | 第８期中間計算期間<br>(2025年３月17日現在) |
|---|---|---|
| 期首元本額 | 10,154,942,383円 | 12,207,789,370円 |
| 期中追加設定元本額 | 3,763,691,049円 | 1,892,889,635円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,710,844,062円 | 903,629,312円 |

# 独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2025年5月28日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）の2024年9月18日から2025年3月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）の2025年3月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年9月18日から2025年3月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の

意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

---

（注）1. 上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
2. XBRL データは中間監査の対象には含まれていません。

【三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型)】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 第７期<br>(2024年 9月 17日現在) | 第８期中間計算期間<br>(2025年 3月 17日現在) |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 14,111,144 | 18,614,761 |
| 金銭信託 | 880,596 | 580,204 |
| コール・ローン | 87,552,212 | 92,371,453 |
| 投資証券 | 129,983,366 | 133,177,769 |
| 親投資信託受益証券 | 6,698,550,681 | 7,328,529,089 |
| 流動資産合計 | 6,931,077,999 | 7,573,273,276 |
| 資産合計 | 6,931,077,999 | 7,573,273,276 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 9,302,687 | 2,966,431 |
| 未払受託者報酬 | 1,126,927 | 1,212,334 |
| 未払委託者報酬 | 31,931,148 | 34,350,745 |
| その他未払費用 | 225,333 | 181,763 |
| 流動負債合計 | 42,586,095 | 38,711,273 |
| 負債合計 | 42,586,095 | 38,711,273 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 5,555,527,628 | 6,027,626,758 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 1,332,964,276 | 1,506,935,245 |
| （分配準備積立金） | 547,844,533 | 526,547,965 |
| 元本等合計 | 6,888,491,904 | 7,534,562,003 |
| 純資産合計 | 6,888,491,904 | 7,534,562,003 |
| 負債純資産合計 | 6,931,077,999 | 7,573,273,276 |

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第７期中間計算期間<br>自　2023年 9月 16日<br>至　2024年 3月 15日 | 第８期中間計算期間<br>自　2024年 9月 18日<br>至　2025年 3月 17日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 3,739,299 | 3,575,408 |
| 受取利息 | 71,690 | 232,916 |
| 有価証券売買等損益 | 293,688,173 | 69,721,182 |
| 為替差損益 | 967,031 | 8,260,586 |
| 営業収益合計 | 298,466,193 | 81,790,092 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 7,740 | － |
| 受託者報酬 | 930,879 | 1,212,334 |
| 委託者報酬 | 26,376,188 | 34,350,745 |
| その他費用 | 207,646 | 204,014 |
| 営業費用合計 | 27,522,453 | 35,767,093 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 270,943,740 | 46,022,999 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 270,943,740 | 46,022,999 |
| 中間純利益又は中間純損失（△） | 270,943,740 | 46,022,999 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△） | 2,619,448 | 8,032,932 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 801,248,384 | 1,332,964,276 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 166,021,431 | 191,901,995 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | － | － |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 166,021,431 | 191,901,995 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 42,060,309 | 55,921,093 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 42,060,309 | 55,921,093 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | － | － |
| 分配金 | － | － |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 1,193,533,798 | 1,506,935,245 |

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 第８期中間計算期間<br>自 2024年９月18日<br>至 2025年３月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　その他中間財務諸表作成のための重要な事項 | (1) 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。<br>(2) 中間計算期間の取扱い<br>当中間計算期間は前期末が休日のため、2024年９月18日から2025年３月17日までとなっております。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | 第７期<br>（2024年９月17日現在） | 第８期中間計算期間<br>（2025年３月17日現在） |
|---|---|---|
| １．　当中間計算期間の末日における受益権の総数 | 5,555,527,628口 | 6,027,626,758口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　1.2399円<br>（１万口当たりの純資産額12,399円） | １口当たり純資産額　1.2500円<br>（１万口当たりの純資産額12,500円） |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | 第８期中間計算期間<br>（2025年３月17日現在） |
|---|---|
| １．　中間貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |

| | |
|---|---|
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

| 項　目 | 第7期<br>(2024年9月17日現在) | 第8期中間計算期間<br>(2025年3月17日現在) |
|---|---|---|
| 期首元本額 | 4,446,804,336円 | 5,555,527,628円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,652,333,710円 | 703,180,055円 |
| 期中一部解約元本額 | 543,610,418円 | 231,080,925円 |

# 独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2025年5月28日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）の2024年9月18日から2025年3月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）の2025年3月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年9月18日から2025年3月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の

意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

---

（注）1. 上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
2. XBRL データは中間監査の対象には含まれていません。

【三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型)】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 第７期<br>(2024年 9月 17日現在) | 第８期中間計算期間<br>(2025年 3月 17日現在) |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 25,917,554 | 43,684,470 |
| 金銭信託 | 2,372,036 | 1,767,925 |
| コール・ローン | 235,836,795 | 281,462,660 |
| 投資証券 | 582,994,442 | 597,321,806 |
| 親投資信託受益証券 | 19,414,065,618 | 21,737,524,360 |
| 流動資産合計 | 20,261,186,445 | 22,661,761,221 |
| 資産合計 | 20,261,186,445 | 22,661,761,221 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 6,389,601 | 12,452,324 |
| 未払受託者報酬 | 3,259,079 | 3,612,020 |
| 未払委託者報酬 | 92,342,051 | 102,342,059 |
| その他未払費用 | 651,763 | 541,709 |
| 流動負債合計 | 102,642,494 | 118,948,112 |
| 負債合計 | 102,642,494 | 118,948,112 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 13,940,089,702 | 15,177,705,692 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 6,218,454,249 | 7,365,107,417 |
| （分配準備積立金） | 2,589,438,084 | 2,476,696,117 |
| 元本等合計 | 20,158,543,951 | 22,542,813,109 |
| 純資産合計 | 20,158,543,951 | 22,542,813,109 |
| 負債純資産合計 | 20,261,186,445 | 22,661,761,221 |

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第７期中間計算期間<br>自　2023年 9月 16日<br>至　2024年 3月 15日 | 第８期中間計算期間<br>自　2024年 9月 18日<br>至　2025年 3月 17日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 13,897,248 | 16,036,223 |
| 受取利息 | 257,301 | 594,186 |
| 有価証券売買等損益 | 1,133,089,369 | 571,364,460 |
| 為替差損益 | 3,624,513 | 34,907,436 |
| 営業収益合計 | 1,150,868,431 | 622,902,305 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 21,560 | － |
| 受託者報酬 | 2,609,072 | 3,612,020 |
| 委託者報酬 | 73,924,934 | 102,342,059 |
| その他費用 | 575,733 | 589,865 |
| 営業費用合計 | 77,131,299 | 106,543,944 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 1,073,737,132 | 516,358,361 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 1,073,737,132 | 516,358,361 |
| 中間純利益又は中間純損失（△） | 1,073,737,132 | 516,358,361 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△） | 13,359,340 | 44,595,632 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 3,801,507,472 | 6,218,454,249 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 773,394,379 | 967,707,212 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | － | － |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 773,394,379 | 967,707,212 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 222,354,827 | 292,816,773 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 222,354,827 | 292,816,773 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | － | － |
| 分配金 | － | － |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 5,412,924,816 | 7,365,107,417 |

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 第８期中間計算期間<br>自 2024年９月18日<br>至 2025年３月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　その他中間財務諸表作成のための重要な事項 | (1) 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。<br>(2) 中間計算期間の取扱い<br>当中間計算期間は前期末が休日のため、2024年９月18日から2025年３月17日までとなっております。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | 第７期<br>（2024年９月17日現在） | 第８期中間計算期間<br>（2025年３月17日現在） |
|---|---|---|
| １．　当中間計算期間の末日における受益権の総数 | 13,940,089,702口 | 15,177,705,692口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　1.4461円<br>（１万口当たりの純資産額14,461円） | １口当たり純資産額　1.4853円<br>（１万口当たりの純資産額14,853円） |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | 第８期中間計算期間<br>（2025年３月17日現在） |
|---|---|
| １．　中間貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |

| | |
|---|---|
| ２．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| ３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

| 項　目 | 第７期<br>(2024年９月17日現在) | 第８期中間計算期間<br>(2025年３月17日現在) |
|---|---|---|
| 期首元本額 | 10,913,676,279円 | 13,940,089,702円 |
| 期中追加設定元本額 | 4,235,031,216円 | 1,887,993,710円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,208,617,793円 | 650,377,720円 |

# 独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2025年5月28日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）の2024年9月18日から2025年3月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）の2025年3月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年9月18日から2025年3月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の

意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

---

（注）1. 上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
2. XBRL データは中間監査の対象には含まれていません。

【三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型)】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 第７期<br>(2024年 9月 17日現在) | 第８期中間計算期間<br>(2025年 3月 17日現在) |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 14,798,754 | 26,332,723 |
| 金銭信託 | 1,297,041 | 917,534 |
| コール・ローン | 128,956,737 | 146,076,057 |
| 投資証券 | 361,852,711 | 399,627,827 |
| 親投資信託受益証券 | 9,370,990,828 | 10,557,642,163 |
| 未収入金 | － | 20,000,000 |
| 流動資産合計 | 9,877,896,071 | 11,150,596,304 |
| 資産合計 | 9,877,896,071 | 11,150,596,304 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 8,970,761 | 32,598,337 |
| 未払受託者報酬 | 1,585,930 | 1,775,212 |
| 未払委託者報酬 | 44,935,940 | 50,299,229 |
| その他未払費用 | 317,136 | 266,199 |
| 流動負債合計 | 55,809,767 | 84,938,977 |
| 負債合計 | 55,809,767 | 84,938,977 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 6,018,491,745 | 6,499,076,841 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 3,803,594,559 | 4,566,580,486 |
| (分配準備積立金) | 1,566,522,192 | 1,477,868,897 |
| 元本等合計 | 9,822,086,304 | 11,065,657,327 |
| 純資産合計 | 9,822,086,304 | 11,065,657,327 |
| 負債純資産合計 | 9,877,896,071 | 11,150,596,304 |

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第７期中間計算期間<br>自　2023年 9月 16日<br>至　2024年 3月 15日 | 第８期中間計算期間<br>自　2024年 9月 18日<br>至　2025年 3月 17日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 8,256,001 | 10,497,341 |
| 受取利息 | 148,778 | 316,699 |
| 有価証券売買等損益 | 663,191,865 | 429,852,468 |
| 為替差損益 | 2,141,670 | 20,502,346 |
| 営業収益合計 | 673,738,314 | 461,168,854 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 9,684 | － |
| 受託者報酬 | 1,225,099 | 1,775,212 |
| 委託者報酬 | 34,712,784 | 50,299,229 |
| その他費用 | 282,451 | 310,560 |
| 営業費用合計 | 36,230,018 | 52,385,001 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 637,508,296 | 408,783,853 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 637,508,296 | 408,783,853 |
| 中間純利益又は中間純損失（△） | 637,508,296 | 408,783,853 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△） | 7,881,690 | 34,457,712 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 2,281,825,213 | 3,803,594,559 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 517,788,400 | 620,141,588 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | － | － |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 517,788,400 | 620,141,588 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 147,430,595 | 231,481,802 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 147,430,595 | 231,481,802 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | － | － |
| 分配金 | － | － |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 3,281,809,624 | 4,566,580,486 |

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 第８期中間計算期間<br>自 2024年９月18日<br>至 2025年３月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| ３．　その他中間財務諸表作成のための重要な事項 | (1) 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。<br>(2) 中間計算期間の取扱い<br>当中間計算期間は前期末が休日のため、2024年９月18日から2025年３月17日までとなっております。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | 第７期<br>（2024年９月17日現在） | 第８期中間計算期間<br>（2025年３月17日現在） |
|---|---|---|
| １．　当中間計算期間の末日における受益権の総数 | 6,018,491,745口 | 6,499,076,841口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　1.6320円<br>（１万口当たりの純資産額16,320円） | １口当たり純資産額　1.7027円<br>（１万口当たりの純資産額17,027円） |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | 第8期中間計算期間<br>(2025年3月17日現在) |
|---|---|
| 1．　中間貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

| 項　目 | 第7期<br>(2024年9月17日現在) | 第8期中間計算期間<br>(2025年3月17日現在) |
|---|---|---|
| 期首元本額 | 4,611,698,310円 | 6,018,491,745円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,970,467,183円 | 843,599,630円 |
| 期中一部解約元本額 | 563,673,748円 | 363,014,534円 |

# 独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2025年5月28日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　和田 渉

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　榊原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）の2024年9月18日から2025年3月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）の2025年3月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年9月18日から2025年3月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の

意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

---

（注）1. 上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
2. XBRL データは中間監査の対象には含まれていません。

【三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型)】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 第７期<br>(2024年 9月 17日現在) | 第８期中間計算期間<br>(2025年 3月 17日現在) |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 14,729,736 | 10,717,636 |
| 金銭信託 | 1,362,405 | 1,085,134 |
| コール・ローン | 135,455,490 | 172,758,893 |
| 投資証券 | 497,647,967 | 567,872,276 |
| 親投資信託受益証券 | 9,942,002,085 | 11,639,169,448 |
| 流動資産合計 | 10,591,197,683 | 12,391,603,387 |
| 資産合計 | 10,591,197,683 | 12,391,603,387 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 11,113,606 | 9,866,716 |
| 未払受託者報酬 | 1,700,593 | 1,955,844 |
| 未払委託者報酬 | 48,184,943 | 55,417,132 |
| その他未払費用 | 340,063 | 293,296 |
| 流動負債合計 | 61,339,205 | 67,532,988 |
| 負債合計 | 61,339,205 | 67,532,988 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 5,830,554,033 | 6,416,025,707 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 4,699,304,445 | 5,908,044,692 |
| （分配準備積立金） | 1,844,981,656 | 1,735,503,707 |
| 元本等合計 | 10,529,858,478 | 12,324,070,399 |
| 純資産合計 | 10,529,858,478 | 12,324,070,399 |
| 負債純資産合計 | 10,591,197,683 | 12,391,603,387 |

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第７期中間計算期間<br>自　2023年 9月 16日<br>至　2024年 3月 15日 | 第８期中間計算期間<br>自　2024年 9月 18日<br>至　2025年 3月 17日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 9,978,579 | 14,488,504 |
| 受取利息 | 177,568 | 336,924 |
| 有価証券売買等損益 | 848,683,597 | 659,831,052 |
| 為替差損益 | 2,421,944 | 27,917,937 |
| 営業収益合計 | 861,261,688 | 702,574,417 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 9,815 | － |
| 受託者報酬 | 1,242,245 | 1,955,844 |
| 委託者報酬 | 35,198,128 | 55,417,132 |
| その他費用 | 289,701 | 343,804 |
| 営業費用合計 | 36,739,889 | 57,716,780 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 824,521,799 | 644,857,637 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 824,521,799 | 644,857,637 |
| 中間純利益又は中間純損失（△） | 824,521,799 | 644,857,637 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△） | 16,869,312 | 54,069,500 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 2,647,439,850 | 4,699,304,445 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 714,817,328 | 919,542,989 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | － | － |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 714,817,328 | 919,542,989 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 225,426,900 | 301,590,879 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 225,426,900 | 301,590,879 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | － | － |
| 分配金 | － | － |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 3,944,482,765 | 5,908,044,692 |

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 第８期中間計算期間<br>自 2024年９月18日<br>至 2025年３月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| ３．　その他中間財務諸表作成のための重要な事項 | (1) 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。<br>(2) 中間計算期間の取扱い<br>当中間計算期間は前期末が休日のため、2024年９月18日から2025年３月17日までとなっております。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | 第７期<br>（2024年９月17日現在） | 第８期中間計算期間<br>（2025年３月17日現在） |
|---|---|---|
| １．　当中間計算期間の末日における受益権の総数 | 5,830,554,033口 | 6,416,025,707口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　1.8060円<br>（１万口当たりの純資産額18,060円） | １口当たり純資産額　1.9208円<br>（１万口当たりの純資産額19,208円） |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | 第8期中間計算期間<br>(2025年3月17日現在) |
|---|---|
| 1．　中間貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

| 項　目 | 第7期<br>(2024年9月17日現在) | 第8期中間計算期間<br>(2025年3月17日現在) |
|---|---|---|
| 期首元本額 | 4,260,660,672円 | 5,830,554,033円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,248,982,809円 | 955,594,851円 |
| 期中一部解約元本額 | 679,089,448円 | 370,123,177円 |

(参考)

「三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型)」、「三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型)」、「三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型)」、「三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型)」および「三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Ｊリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。
なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

（１）貸借対照表

（単位：円）

| | （2025年3月17日現在） |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 金銭信託 | 34,585,840 |
| コール・ローン | 5,506,240,801 |
| 株式 | 359,957,376,970 |
| 派生商品評価勘定 | 234,325,900 |
| 未収配当金 | 559,271,450 |
| 差入委託証拠金 | 317,802,125 |
| 流動資産合計 | 366,609,603,086 |
| 資産合計 | 366,609,603,086 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 前受金 | 147,955,000 |
| 未払解約金 | 168,330,079 |
| 流動負債合計 | 316,285,079 |
| 負債合計 | 316,285,079 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 73,815,858,968 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 292,477,459,039 |
| 元本等合計 | 366,293,318,007 |
| 純資産合計 | 366,293,318,007 |
| 負債純資産合計 | 366,609,603,086 |

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 自 2024年9月18日<br>至 2025年3月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br><br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | （2025年3月17日現在） |
|---|---|
| １．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 73,815,858,968口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　4.9623円<br>（１万口当たりの純資産額49,623円） |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | （2025年3月17日現在） |
|---|---|
| １．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| ２．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（株式）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| ３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ |

| | |
|---|---|
| | 取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2025年3月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区　分 | 種　類 | 契　約　額　等 | | 時　価 | 評価損益 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | うち１年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | TOPIX 先物 0706 月 | 6,069,664,100 | － | 6,303,990,000 | 234,325,900 |
| | 小計 | 6,069,664,100 | － | 6,303,990,000 | 234,325,900 |
| 合　計 | | 6,069,664,100 | － | 6,303,990,000 | 234,325,900 |

(注) １．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

| (2025年3月17日現在) | |
|---|---|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 70,434,529,577円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 6,102,248,078円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 2,720,918,687円 |
| | |
| 2025年3月17日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド | 9,678,852,472円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型） | 969,642,880円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型） | 4,339,269,801円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型） | 3,801,624,291円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 126,952,593円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ） | 2,972,222円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ） | 11,408,167円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ） | 35,067,399円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ） | 115,364,869円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ） | 118,024,420円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ） | 241,058,568円 |
| 国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ） | 1,575,048,288円 |

| | |
|---|---|
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド | 31,068,427,036 円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 168,334,244 円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 262,798,413 円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 160,436,158 円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 37,563,248 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０ | 102,139,840 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 221,466,885 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 229,200,180 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 960,656,610 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 585,609,246 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 759,524,803 円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 77,797,061 円 |
| 三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド | 1,882,490,686 円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型） | 43,588,248 円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型） | 273,297,107 円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型） | 309,990,779 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０ | 23,932,966 円 |
| 日興ＦＷＳ・日本株インデックス | 3,306,606,361 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＴＯＰＩＸインデックス・ファンド | 335,335,085 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５ | 58,563,519 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０ | 37,648,388 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５ | 36,392,048 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５ | 24,445,710 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５ | 19,889,085 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 1,316,534 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 31,187,012 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 174,859,775 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 166,841,330 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 63,227,500 円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（保守コース） | 959,370 円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（安定コース） | 2,155,208 円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（標準コース） | 2,953,809 円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（成長コース） | 3,308,048 円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（積極コース） | 572,343 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０７０ | 268,411 円 |
| ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 2,054,389,121 円 |
| バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞ | 6,182,205 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞ | 30,933,278 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 532,620,813 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞ | 914,295,406 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 3,651,529,471 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞ | 22,448,074 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞ | 83,955,582 円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞ | 537,490,730 円 |

| | |
|---|---|
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞ | 28,355,118円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 149,003,225円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 530,271,741円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞ | 323,749,218円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞ | 939,540,951円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 21,353,661円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 20,264,787円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 16,012,834円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 13,108,576円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 47,762,738円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 131,530,059円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 26,002,417円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 24,220,916円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 5,893,479円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞ | 23,037,415円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞ | 302,748,509円 |
| ＳＭＡＭ・国内株式インデックスファンド・ＶＡ（適格機関投資家専用） | 143,107,565円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 119,934,421円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 49,757,360円 |
| ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 33,666,452円 |
| ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞ | 20,494,229円 |
| ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 46,741,240円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞ | 20,662,261円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞ | 32,970,297円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞ | 400,839,051円 |
| ＳＭＤＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定＞ | 61,916,752円 |
| 合　計 | 73,815,858,968円 |

外国株式インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

（2025年3月17日現在）

| | |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 8,192,790,640 |
| 金銭信託 | 8,064,655 |
| コール・ローン | 1,283,933,897 |
| 株式 | 881,471,211,462 |
| 投資証券 | 17,293,968,897 |
| 派生商品評価勘定 | 12,971,358 |
| 未収入金 | 6,566,032 |

| | |
|---|---|
| 未収配当金 | 1,386,423,410 |
| 差入委託証拠金 | 3,444,918,816 |
| 流動資産合計 | 913,100,849,167 |
| 資産合計 | 913,100,849,167 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 381,159,489 |
| 未払解約金 | 1,176,388,509 |
| 流動負債合計 | 1,557,547,998 |
| 負債合計 | 1,557,547,998 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 96,448,743,077 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 815,094,558,092 |
| 元本等合計 | 911,543,301,169 |
| 純資産合計 | 911,543,301,169 |
| 負債純資産合計 | 913,100,849,167 |

（２）注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項　目 | 自 2024年9月18日<br>至 2025年3月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式、新株予約権証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | (1) 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。<br>(2) 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |

| | |
|---|---|
| 3．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項　目 | (2025年3月17日現在) |
|---|---|
| 1．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 96,448,743,077口 |
| 2．　1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額　9.4511円<br>(1万口当たりの純資産額94,511円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | (2025年3月17日現在) |
|---|---|
| 1．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券(株式、新株予約権証券、投資証券)<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2025年3月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区　分 | 種　類 | 契　約　額　等 | うち1年超 | 時　価 | 評価損益 |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | S&P 500 EMINI FUT MAR25 | 10,325,994,539 | - | 9,989,545,440 | △336,449,099 |
| | SPI 200 FUTURES MAR25 | 363,750,443 | - | 348,279,519 | △15,470,924 |
| | FTSE 100 IDX FUT | 502,242,876 | - | 498,908,160 | △3,334,716 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | MAR25 | | | | |
| | EURO STOXX 50 MAR25 | 1,813,130,765 | － | 1,800,197,373 | △12,933,392 |
| | 小計 | 13,005,118,623 | － | 12,636,930,492 | △368,188,131 |
| 合　計 | | 13,005,118,623 | － | 12,636,930,492 | △368,188,131 |

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

| （2025年3月17日現在） | |
|---|---|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 89,293,103,807円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 10,577,007,324円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 3,421,368,054円 |
| | |
| 2025年3月17日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・ＤＣ外国株式インデックスファンドＳ | 48,416,222,515円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型） | 247,070,208円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型） | 925,170,791円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型） | 758,107,690円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 37,780,626円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ） | 629,395円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ） | 2,449,693円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ） | 8,558,065円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ） | 28,985,667円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ） | 36,778,817円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ） | 84,345,063円 |
| 外国株式指数ファンド | 1,280,233,143円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド | 26,297,769,400円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 69,517,864円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 107,932,562円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 66,086,727円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 18,591,245円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０ | 41,381,206円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 157,329,703円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 145,590,157円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 602,639,684円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 372,679,762円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 554,408,009円 |

| | |
|---|---|
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 80,088,363円 |
| 三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド | 3,788,167,115円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型） | 10,859,439円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型） | 58,336,730円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型） | 62,814,664円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０ | 10,041,605円 |
| ＳＭＢＣ・ＤＣインデックスファンド（ＭＳＣＩコクサイ） | 3,160,054,746円 |
| 日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジあり） | 154,679,031円 |
| 日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジなし） | 3,832,718,668円 |
| 三井住友ＤＳ・先進国株式インデックス・ファンド | 191,657,994円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５ | 20,014,177円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０ | 13,612,247円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５ | 14,012,875円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５ | 10,336,131円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５ | 8,299,568円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 232,804円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 6,544,679円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 37,500,525円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 36,147,069円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 13,392,430円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（保守コース） | 510,324円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（安定コース） | 1,468,856円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（標準コース） | 2,256,711円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（成長コース） | 2,944,202円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（積極コース） | 5,774,046円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０７０ | 104,784円 |
| ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 202,695,181円 |
| バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞ | 1,602,369円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞ | 7,334,511円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 175,718,656円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞ | 391,269,869円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 1,806,124,377円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞ | 5,402,429円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞ | 27,527,023円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞ | 297,369,165円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞ | 21,384,239円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 48,353,362円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 259,907,628円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞ | 158,522,803円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞ | 343,214,315円 |
| 三井住友・外国株式インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用） | 151,420,845円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 30,652,214円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 3,366,872円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 3,033,356円 |

| | |
|---|---|
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 2,696,766円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 7,824,905円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 27,714,101円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 58,597,008円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 24,254,985円 |
| ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 97,607,240円 |
| ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞ | 33,833,048円 |
| ＳＭＡＭ・外国株式インデックスファンドＳＡ＜適格機関投資家限定＞ | 178,776,064円 |
| ＳＭＡＭ・年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 26,859,125円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞ | 12,663,287円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞ | 19,450,190円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞ | 199,447,694円 |
| ＳＭＤＡＭ・年金Wリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定＞ | 41,291,675円 |
| 合　計 | 96,448,743,077円 |

エマージング株式インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

| | （2025年3月17日現在） |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 2,698,597,631 |
| 金銭信託 | 622,139 |
| コール・ローン | 99,047,757 |
| 株式 | 47,833,719,848 |
| 投資信託受益証券 | 2,223,237,209 |
| 投資証券 | 4,077,602,772 |
| 派生商品評価勘定 | 91,311,853 |
| 未収入金 | 740,999 |
| 未収配当金 | 93,392,747 |
| 差入委託証拠金 | 655,098,476 |
| 流動資産合計 | 57,773,371,431 |
| 資産合計 | 57,773,371,431 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,479,402 |
| 未払金 | 59,286,909 |
| 未払解約金 | 160,523,280 |
| 流動負債合計 | 221,289,591 |
| 負債合計 | 221,289,591 |
| 純資産の部 | |

| | |
|---|---|
| 元本等 | |
| 元本 | 26,482,774,020 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 31,069,307,820 |
| 元本等合計 | 57,552,081,840 |
| 純資産合計 | 57,552,081,840 |
| 負債純資産合計 | 57,773,371,431 |

（2）注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 自 2024年9月18日<br>至 2025年3月17日 |
|---|---|
| 1．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| 2．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | (1) 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。<br>(2) 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| 3．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | (2025年3月17日現在) |
|---|---|
| 1．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 26,482,774,020口 |
| 2．　1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額　2.1732円<br>（1万口当たりの純資産額21,732円） |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | (2025年3月17日現在) |
|---|---|
| 1．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

(2025年3月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

| 区　分 | 種　類 | 契　約　額　等 | | 時　価 | 評価損益 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | MSCI EMGMKT MAR25 | 3,372,145,831 | － | 3,462,551,247 | 90,405,416 |
| | 小計 | 3,372,145,831 | － | 3,462,551,247 | 90,405,416 |
| 合　計 | | 3,372,145,831 | － | 3,462,551,247 | 90,405,416 |

(注) 1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（単位：円）

| 区　分 | 種　類 | 契　約　額　等 | | 時　価 | 評価損益 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | アメリカ・ドル | 146,100,000 | － | 146,672,966 | △572,966 |
| | 小計 | 146,100,000 | － | 146,672,966 | △572,966 |
| 合　計 | | 146,100,000 | － | 146,672,966 | △572,966 |

（注）１．時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2)計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

| （2025年3月17日現在） | |
|---|---|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 23,828,437,374円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 3,864,466,974円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,210,130,328円 |
| | |
| 2025年3月17日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド | 14,015,339,183円 |
| 三井住友・ＤＣ新興国株式インデックスファンド | 3,647,460,264円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 196,467,052円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 300,880,829円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 206,352,120円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 54,888,361円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０ | 78,070,105円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 125,430,522円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 104,508,106円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 523,657,183円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 355,860,119円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 567,405,773円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 174,895,031円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０ | 18,701,825円 |

| | |
|---|---|
| 日興ＦＷＳ・新興国株インデックス（為替ヘッジあり） | 431,490,159円 |
| 日興ＦＷＳ・新興国株インデックス（為替ヘッジなし） | 5,241,389,794円 |
| 三井住友ＤＳ・新興国株式インデックス・ファンド | 77,560,811円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５ | 42,724,625円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０ | 27,466,784円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５ | 27,531,410円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５ | 18,920,588円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５ | 15,569,511円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 398,466円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 10,366,505円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 56,620,052円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 54,094,415円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 20,834,378円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（保守コース） | 209,941円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（安定コース） | 461,355円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（標準コース） | 498,778円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（成長コース） | 600,137円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０７０ | 208,013円 |
| ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 85,911,825円 |
| 合　計 | 26,482,774,020円 |

Ｊリート・インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

| | （2025年3月17日現在） |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 金銭信託 | 371,101 |
| コール・ローン | 59,081,172 |
| 投資証券 | 19,841,026,450 |
| 派生商品評価勘定 | 621,600 |
| 未収入金 | 35,260,393 |
| 未収配当金 | 319,486,304 |
| 差入委託証拠金 | 1,946,997 |
| 流動資産合計 | 20,257,794,017 |
| 資産合計 | 20,257,794,017 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 前受金 | 496,000 |
| 未払金 | 43,936,075 |
| 未払解約金 | 51,727,900 |
| 流動負債合計 | 96,159,975 |
| 負債合計 | 96,159,975 |
| 純資産の部 | |

| | |
|---|---|
| 元本等 | |
| 元本 | 7,839,893,633 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 12,321,740,409 |
| 元本等合計 | 20,161,634,042 |
| 純資産合計 | 20,161,634,042 |
| 負債純資産合計 | 20,257,794,017 |

（2）注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 自 2024年9月18日<br>至 2025年3月17日 |
|---|---|
| 1．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| 2．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | (2025年3月17日現在) |
|---|---|
| 1．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 7,839,893,633口 |
| 2．　1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額　2.5717円<br>（1万口当たりの純資産額25,717円） |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | (2025年3月17日現在) |
|---|---|
| 1．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（投資証券） |

| | |
|---|---|
| | 「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2025年3月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区　分 | 種　類 | 契　約　額　等 | | 時　価 | 評価損益 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | リート指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | TREIT 先物 0706 月 | 32,788,400 | － | 33,410,000 | 621,600 |
| | 小計 | 32,788,400 | － | 33,410,000 | 621,600 |
| 合　計 | | 32,788,400 | － | 33,410,000 | 621,600 |

(注) 1．時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

| (2025年3月17日現在) | |
|---|---|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 6,047,916,666円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,096,891,307円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 304,914,340円 |
| | |
| 2025年3月17日現在の元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 225,103,892円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 388,793,501円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 240,596,681円 |

| | |
|---|---|
| イオン・バランス戦略ファンド | 92,423,741円 |
| 三井住友・ＤＣ日本リートインデックスファンド | 2,964,410,125円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０ | 63,786,224円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 54,045,042円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 60,172,289円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 272,920,664円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 178,584,175円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 150,915,800円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 74,339,803円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０ | 15,630,873円 |
| 三井住友ＤＳ・国内リートインデックス年金ファンド | 481,408,731円 |
| 日興ＦＷＳ・Ｊリートインデックス | 1,466,010,953円 |
| 三井住友ＤＳ・国内リートインデックス・ファンド | 352,367,321円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５ | 35,617,729円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０ | 23,157,391円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５ | 22,763,620円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５ | 15,676,216円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５ | 13,023,699円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 1,046,526円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 28,423,247円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 168,803,442円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 164,725,770円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 63,439,871円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（保守コース） | 363,828円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（安定コース） | 607,776円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（標準コース） | 819,126円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（成長コース） | 314,433円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０７０ | 183,168円 |
| ＳＭＡＭ・世界リート・インデックスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 2,532,353円 |
| ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 100,637,074円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞ | 45,741,536円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞ | 70,507,013円 |
| 合　計 | 7,839,893,633円 |

外国リート・インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

（2025年3月17日現在）

| | |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 881,216,060 |
| 金銭信託 | 155,734 |
| コール・ローン | 24,793,704 |

| | |
|---|---|
| 投資証券 | 43,009,091,195 |
| 派生商品評価勘定 | 455 |
| 未収入金 | 938,777 |
| 未収配当金 | 132,201,973 |
| 流動資産合計 | 44,048,397,898 |
| 資産合計 | 44,048,397,898 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 203,556 |
| 未払解約金 | 61,848,858 |
| 流動負債合計 | 62,052,414 |
| 負債合計 | 62,052,414 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 12,643,114,018 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 31,343,231,466 |
| 元本等合計 | 43,986,345,484 |
| 純資産合計 | 43,986,345,484 |
| 負債純資産合計 | 44,048,397,898 |

（２）注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項　目 | 自 2024年9月18日<br>至 2025年3月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| ２．　デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| ３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理して |

| | |
|---|---|
| | おります。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項　目 | (2025年3月17日現在) |
|---|---|
| 1．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 12,643,114,018口 |
| 2．　1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額　3.4791円<br>(1万口当たりの純資産額34,791円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | (2025年3月17日現在) |
|---|---|
| 1．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　時価の算定方法 | (1) 有価証券(投資証券)<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2025年3月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区　分 | 種　類 | 契　約　額　等 | | 時　価 | 評価損益 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 11,700,000 | － | 11,700,455 | 455 |
| | 小計 | 11,700,000 | － | 11,700,455 | 455 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 36,000,000 | － | 36,145,482 | △145,482 |
| | オーストラリア・ドル | 6,000,000 | － | 6,027,434 | △27,434 |
| | ユーロ | 10,500,000 | － | 10,530,640 | △30,640 |
| | 小計 | 52,500,000 | － | 52,703,556 | △203,556 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 合　計 | 64,200,000 | － | 64,404,011 | △203,101 |

（注）１．時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2)計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

| （2025年3月17日現在） | |
|---|---|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 11,577,053,279円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 1,501,444,429円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 435,383,690円 |
| | |
| 2025年3月17日現在の元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 13,743,614円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 23,060,174円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 14,605,011円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 48,777,613円 |
| 三井住友・ＤＣ外国リートインデックスファンド | 9,723,226,451円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０ | 14,597,008円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 38,740,973円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 41,313,770円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 190,223,784円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 124,238,371円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 105,275,637円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 162,003,531円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０ | 3,610,371円 |
| 三井住友ＤＳ・外国リートインデックス年金ファンド | 701,816,036円 |
| 日興ＦＷＳ・Ｇリートインデックス（為替ヘッジあり） | 56,659,102円 |
| 日興ＦＷＳ・Ｇリートインデックス（為替ヘッジなし） | 1,099,497,011円 |

| | |
|---|---|
| 三井住友ＤＳ・先進国リートインデックス・ファンド | 129,661,251 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５ | 9,802,390 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０ | 5,525,173 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５ | 5,107,255 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５ | 3,667,855 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５ | 2,960,982 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 79,254 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 2,081,565 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 13,432,463 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 12,496,806 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 4,744,030 円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（保守コース） | 71,401 円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（安定コース） | 210,079 円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（標準コース） | 252,878 円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（成長コース） | 325,976 円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（積極コース） | 794,701 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０７０ | 40,539 円 |
| ＳＭＡＭ・世界リート・インデックスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 28,178,672 円 |
| ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 62,292,291 円 |
| 合　計 | 12,643,114,018 円 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

| | （2025 年 3 月 17 日現在） |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 金銭信託 | 2,534,693 |
| コール・ローン | 403,535,958 |
| 国債証券 | 97,618,498,520 |
| 地方債証券 | 10,512,593,800 |
| 特殊債券 | 9,937,708,229 |
| 社債券 | 7,772,217,500 |
| 未収入金 | 130,933,200 |
| 未収利息 | 410,876,788 |
| 前払費用 | 20,293,716 |
| 流動資産合計 | 126,809,192,404 |
| 資産合計 | 126,809,192,404 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 140,040,000 |
| 流動負債合計 | 140,040,000 |
| 負債合計 | 140,040,000 |
| 純資産の部 | |

| | |
|---|---|
| 元本等 | |
| 元本 | 109,933,943,138 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 16,735,209,266 |
| 元本等合計 | 126,669,152,404 |
| 純資産合計 | 126,669,152,404 |
| 負債純資産合計 | 126,809,192,404 |

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 自 2024年9月18日<br>至 2025年3月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 項　目 | (2025年3月17日現在) |
|---|---|
| １．　当計算期間の末日における受益権の総数 | 109,933,943,138口 |
| ２．　１単位当たり純資産の額 | １口当たり純資産額　1.1522円<br>（１万口当たりの純資産額11,522円） |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | (2025年3月17日現在) |
|---|---|
| １．　貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| ２．　時価の算定方法 | (1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 |

| | |
|---|---|
| | (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| ３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

| (2025年3月17日現在) | |
|---|---|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 114,582,435,445円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 8,875,721,860円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 13,524,214,167円 |
| | |
| 2025年3月17日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型） | 11,276,303,144円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型） | 18,326,023,664円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型） | 4,835,009,165円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 847,656,906円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ） | 44,658,768円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ） | 172,593,003円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ） | 529,745,377円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ） | 1,254,766,037円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ） | 738,342,855円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ） | 890,599,819円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型） | 122,073,784円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 846,833,080円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 308,628,448円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 12,232,019円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０ | 288,634,242円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 4,247,261,633円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 1,298,881,328円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 2,734,733,396円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 678,185,931円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 111,471,807円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 495,396,025円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型） | 502,856,563円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型） | 1,152,589,959円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型） | 394,820,519円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０ | 52,164,335円 |

| | |
|---|---|
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５ | 745,541,368円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０ | 366,852,376円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５ | 216,054,018円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５ | 53,385,576円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５ | 43,405,765円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 20,810,566円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 170,828,392円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 535,336,223円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 249,534,955円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 28,507,965円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（保守コース） | 7,010,822円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（安定コース） | 1,643,275円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（標準コース） | 304,318円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（成長コース） | 216,879円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０７０ | 584,592円 |
| ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞ | 951,161,883円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 6,032,575,957円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞ | 5,791,496,125円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 15,310,659,675円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞ | 287,320,892円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞ | 475,188,335円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞ | 313,711,942円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞ | 120,400,745円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 1,693,405,427円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 2,225,025,190円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞ | 2,058,637,372円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞ | 6,970,356,513円 |
| 三井住友・国内債券インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用） | 818,500,986円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 356,302,221円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 375,123,071円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 133,126,312円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 54,869,828円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 970,644,146円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 1,827,287,777円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 491,896,889円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 206,044,271円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 25,403,876円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞ | 230,398,149円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞ | 4,268,110,917円 |
| ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 1,222,936,341円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞ | 628,164,332円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞ | 966,463,279円 |
| ＳＭＤＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定 | 526,251,790円 |

| | |
|---|---|
| ＞ | |
| 合　計 | 109,933,943,138円 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

| | （2025年3月17日現在） |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 240,087,052 |
| 金銭信託 | 3,227,554 |
| コール・ローン | 513,842,863 |
| 国債証券 | 196,666,890,231 |
| 未収利息 | 1,627,433,570 |
| 前払費用 | 176,238,499 |
| 流動資産合計 | 199,227,719,769 |
| 資産合計 | 199,227,719,769 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 380,397,376 |
| 流動負債合計 | 380,397,376 |
| 負債合計 | 380,397,376 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 86,963,304,583 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 111,884,017,810 |
| 元本等合計 | 198,847,322,393 |
| 純資産合計 | 198,847,322,393 |
| 負債純資産合計 | 199,227,719,769 |

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 自 2024年9月18日<br>至 2025年3月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br><br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>　金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>　金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提 |

| | |
|---|---|
| | 供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| 3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項　目 | (2025年3月17日現在) |
|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 86,963,304,583口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額　2.2866円<br>(1万口当たりの純資産額22,866円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | (2025年3月17日現在) |
|---|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券(国債証券)<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

| (2025年3月17日現在) |
|---|
| 開示対象ファンドの |

| | |
|---|---|
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 80,572,354,466 円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 11,512,545,848 円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 5,121,595,731 円 |
| | |
| 2025 年 3 月 17 日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・ＤＣ外国債券インデックスファンドＳ | 30,533,810,057 円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型） | 1,041,373,430 円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型） | 2,666,928,664 円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型） | 1,634,032,209 円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 169,435,528 円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ） | 5,524,224 円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ） | 21,717,939 円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ） | 67,530,089 円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ） | 235,457,654 円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ） | 201,161,625 円 |
| 三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ） | 341,770,211 円 |
| 三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型） | 16,344,114 円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 75,787,774 円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 123,753,800 円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 76,009,518 円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 79,782,143 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０ | 70,910,833 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 416,739,541 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 296,634,570 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 887,384,268 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 295,201,737 円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 167,611,626 円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 336,176,438 円 |
| 三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド | 1,613,993,781 円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型） | 46,891,144 円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型） | 167,836,809 円 |
| 三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型） | 132,245,395 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０ | 16,993,249 円 |
| 日興ＦＷＳ・先進国債インデックス（為替ヘッジなし） | 4,986,158,571 円 |
| 三井住友ＤＳ・先進国債インデックス・ファンド | 252,605,508 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５ | 38,376,205 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０ | 24,785,379 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５ | 25,017,480 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５ | 17,232,482 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５ | 14,160,721 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 1,439,574 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 5,538,524 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 28,808,141 円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 28,319,437 円 |

| | |
|---|---|
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 10,406,834円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（保守コース） | 112,427円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（安定コース） | 242,352円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（標準コース） | 353,892円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（成長コース） | 444,425円 |
| 三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０７０ | 188,688円 |
| ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞ | 7,491,877,288円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞ | 16,637,845円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 2,671,408,869円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞ | 3,199,732,094円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 7,801,870,057円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞ | 23,930,035円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞ | 60,417,188円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞ | 651,584,801円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞ | 91,764,677円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞ | 757,803,461円 |
| ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞ | 1,152,957,569円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞ | 1,045,056,393円 |
| ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞ | 3,028,119,395円 |
| ＳＭＡＭ・外国債券パッシブファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 5,318,550,888円 |
| 三井住友・外国債券インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用） | 262,848,567円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 88,837,191円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 43,714,593円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 20,041,970円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞ | 11,816,161円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 50,699,264円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞ | 281,011,555円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 56,079,192円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 30,972,355円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞ | 5,723,530円 |
| ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞ | 652,420,036円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 420,114,916円 |
| ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 548,829,995円 |
| ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞ | 201,014,225円 |
| ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞ | 169,295,618円 |
| ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 170,338,844円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞ | 78,212,696円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞ | 120,287,190円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞ | 2,988,734,977円 |
| ＳＭＤＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定＞ | 277,372,138円 |
| 合　計 | 86,963,304,583円 |

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

| | （2025年3月17日現在） |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 68,239,666 |
| 金銭信託 | 1,389,317 |
| コール・ローン | 221,186,253 |
| 国債証券 | 34,127,207,231 |
| 派生商品評価勘定 | 197,114,538 |
| 未収入金 | 243,294,410 |
| 未収利息 | 266,556,281 |
| 前払費用 | 49,456,576 |
| 流動資産合計 | 35,174,444,272 |
| 資産合計 | 35,174,444,272 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 398,297,877 |
| 未払解約金 | 365,234,598 |
| 流動負債合計 | 763,532,475 |
| 負債合計 | 763,532,475 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 28,737,621,707 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 5,673,290,090 |
| 元本等合計 | 34,410,911,797 |
| 純資産合計 | 34,410,911,797 |
| 負債純資産合計 | 35,174,444,272 |

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項　目 | 自 2024年9月18日<br>至 2025年3月17日 |
|---|---|
| １．　有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。<br><br>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券<br>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。<br>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券<br>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業 |

| | |
|---|---|
| | 者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br>(3) 時価が入手できなかった有価証券<br>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| 3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項　目 | (2025年3月17日現在) |
|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 28,737,621,707口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額　1.1974円<br>(1万口当たりの純資産額11,974円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項　目 | (2025年3月17日現在) |
|---|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券（国債証券）<br>「重要な会計方針の注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2025年3月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区　分 | 種　類 | 契　約　額　等 | 時　価 | 評価損益 |
|---|---|---|---|---|

| | | | うち1年超 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 120,300,691 | － | 120,451,379 | 150,688 |
| | カナダ・ドル | 5,148,468 | － | 5,176,852 | 28,384 |
| | オーストラリア・ドル | 2,800,449 | － | 2,821,200 | 20,751 |
| | シンガポール・ドル | 1,111,766 | － | 1,115,006 | 3,240 |
| | イギリス・ポンド | 13,438,726 | － | 13,445,145 | 6,419 |
| | イスラエル・シュケル | 11,661,473 | － | 11,413,136 | △248,337 |
| | メキシコ・ペソ | 7,267,101 | － | 7,365,217 | 98,116 |
| | オフショア・人民元 | 21,935,487 | － | 22,000,698 | 65,211 |
| | ユーロ | 75,670,587 | － | 76,000,974 | 330,387 |
| | 小計 | 259,334,748 | － | 259,789,607 | 454,859 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 16,731,995,774 | － | 16,556,051,920 | 175,943,854 |
| | カナダ・ドル | 693,466,683 | － | 687,465,988 | 6,000,695 |
| | オーストラリア・ドル | 433,561,876 | － | 436,619,811 | △3,057,935 |
| | シンガポール・ドル | 311,017,937 | － | 311,086,674 | △68,737 |
| | ニュージーランド・ドル | 98,473,772 | － | 99,987,030 | △1,513,258 |
| | イギリス・ポンド | 1,836,974,693 | － | 1,866,056,670 | △29,081,977 |
| | イスラエル・シュケル | 128,104,461 | － | 125,136,884 | 2,967,577 |
| | デンマーク・クローネ | 74,881,196 | － | 77,386,176 | △2,504,980 |
| | ノルウェー・クローネ | 48,471,875 | － | 50,714,730 | △2,242,855 |
| | スウェーデン・クローナ | 55,914,781 | － | 58,606,716 | △2,691,935 |
| | メキシコ・ペソ | 284,174,865 | － | 290,334,203 | △6,159,338 |
| | オフショア・人民元 | 3,960,200,411 | － | 3,949,449,227 | 10,751,184 |
| | ポーランド・ズロチ | 202,382,111 | － | 207,851,875 | △5,469,764 |
| | ユーロ | 10,233,180,648 | － | 10,577,691,377 | △344,510,729 |
| | 小計 | 35,092,801,083 | － | 35,294,439,281 | △201,638,198 |
| 合　計 | | 35,352,135,831 | － | 35,554,228,888 | △201,183,339 |

（注）１．時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2)計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

| (2025年3月17日現在) | |
|---|---|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 30,179,065,454円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 4,809,632,733円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 6,251,076,480円 |
| | |
| 2025年3月17日現在の元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 1,632,917,758円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 591,295,655円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 12,173,541円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 736,000,095円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型） | 3,743,035,219円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型） | 1,766,101,056円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型） | 3,000,758,340円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型） | 841,964,036円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型） | 109,616,312円 |
| 三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド | 156,001,975円 |
| 日興ＦＷＳ・先進国債インデックス（為替ヘッジあり） | 381,785,892円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型） | 15,695,243円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型） | 205,333,842円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル３（安定成長型） | 644,577,896円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型） | 302,677,888円 |
| 三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル５（積極成長型） | 33,530,160円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（保守コース） | 27,105,622円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（安定コース） | 15,898,112円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（標準コース） | 7,027,733円 |
| 三井住友ＤＳ・バランスファンド（成長コース） | 208,763円 |
| ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞ | 919,215,026円 |
| ＳＭＡＭ・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞ | 10,771,202,154円 |
| ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 1,010,082,849円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞ | 520,335,648円 |
| ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞ | 805,201,356円 |
| ＳＭＤＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド（リスク３％）＜適格機関投資家限定＞ | 487,879,536円 |

| | |
|---|---|
| 合　計 | 28,737,621,707円 |

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

2025年3月31日現在

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 13,786,120,975円 |
| Ⅱ　負債総額 | 64,740,301円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 13,721,380,674円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 13,204,074,973口 |
| Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）<br>（１万口当たり純資産額） | 1.0392円<br>（10,392円） |

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

2025年3月31日現在

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 7,586,357,884円 |
| Ⅱ　負債総額 | 15,909,001円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 7,570,448,883円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 6,064,509,264口 |
| Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）<br>（１万口当たり純資産額） | 1.2483円<br>（12,483円） |

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

2025年3月31日現在

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 22,742,273,083円 |
| Ⅱ　負債総額 | 42,456,719円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 22,699,816,364円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 15,334,320,627口 |
| Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）<br>（１万口当たり純資産額） | 1.4803円<br>（14,803円） |

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

2025年3月31日現在

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 11,119,022,101円 |
| Ⅱ　負債総額 | 21,436,926円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 11,097,585,175円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 6,552,126,423口 |

| | |
|---|---|
| Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）<br>（１万口当たり純資産額） | 1.6937円<br>（16,937円） |

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

2025年3月31日現在

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 12,387,284,036円 |
| Ⅱ　負債総額 | 18,548,868円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 12,368,735,168円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 6,487,369,239口 |
| Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）<br>（１万口当たり純資産額） | 1.9066円<br>（19,066円） |

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券は発行されません。

イ　名義書換

該当事項はありません。

ロ　受益者名簿

作成しません。

ハ　受益者に対する特典

ありません。

ニ　受益権の譲渡および譲渡制限等

（イ）受益権の譲渡

ａ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

ｂ．上記ａの申請のある場合には、上記ａの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記ａの振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

ｃ．上記ａの振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（ロ）受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

ホ　受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

ヘ　償還金

償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。

ト　質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

イ　資本金の額および株式数

| | 2025年3月31日現在 |
|---|---|
| 資本金の額 | 20億円 |
| 会社が発行する株式の総数 | 60,000,000株 |
| 発行済株式総数 | 33,870,060株 |

ロ　最近５年間における資本金の額の増減

該当ありません。

ハ　会社の機構

委託会社の取締役は８名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

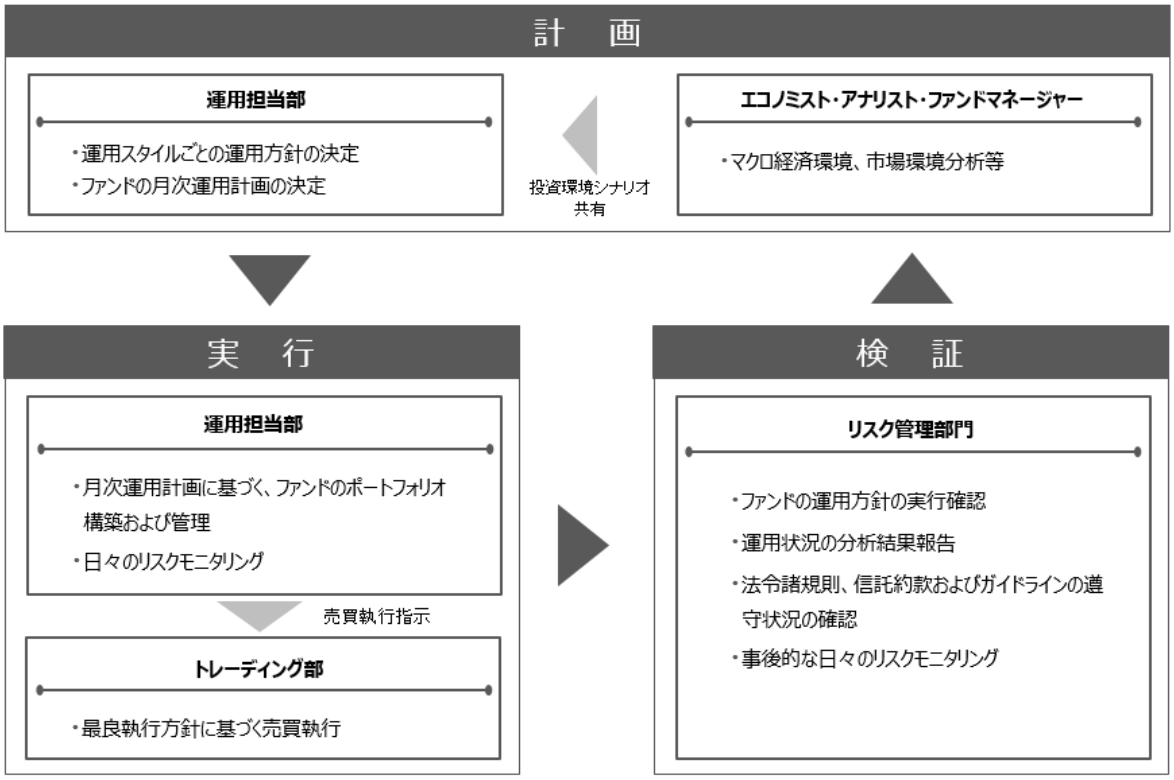
取締役の任期は、選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を１名選定し、必要に応じて取締役会長１名を選定することができます。

ニ　投資信託の運用の流れ




2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2025 年 3 月 31 日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

| | 本　数（本） | 純資産総額（百万円） |
|---|---|---|
| 追加型株式投資信託 | 656 | 13,284,091 |
| 単位型株式投資信託 | 77 | 594,585 |
| 追加型公社債投資信託 | 1 | 22,415 |
| 単位型公社債投資信託 | 132 | 192,346 |
| 合　計 | 866 | 14,093,438 |

3【委託会社等の経理状況】

1　当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第 2 条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年内閣府令第 52 号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「財務諸表等規則」並びに同規則第 2 条、第 282 条及び第 306 条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年内閣府令第 52 号）に基づいて作成しております。

2　当社は、第 39 期（2023 年 4 月 1 日から 2024 年 3 月 31 日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第 40 期中間会計期間（2024 年 4 月 1 日から 2024 年 9 月 30 日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

# 独立監査人の監査報告書

2024年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 佐　藤　栄　裕 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深　井　康　治 |

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2023年４月１日から2024年３月31日までの第39期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2024年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視す

ることにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

---

（注）１．上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2024年11月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 佐　藤　栄　裕 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深　井　康　治 |

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2024年４月１日から2025年３月31日までの第40期事業年度の中間会計期間（2024年４月１日から2024年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2024年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年４月１日から2024年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告

書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

---

（注）１．上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

| | | 前事業年度<br>(2023年3月31日) | 当事業年度<br>(2024年3月31日) |
|---|---|---|---|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 現金及び預金 | | 37,742,400 | 66,540,261 |
| 金銭の信託 | | 12,645,575 | 23,435,831 |
| 顧客分別金信託 | | 300,046 | 300,051 |
| 前払費用 | | 546,900 | 583,635 |
| 未収入金 | | 437,880 | 193,837 |
| 未収委託者報酬 | | 11,563,662 | 14,480,419 |
| 未収運用受託報酬 | | 2,138,030 | 3,342,186 |
| 未収投資助言報酬 | | 344,586 | 406,420 |
| 未収収益 | | 35,477 | 84,166 |
| その他の流動資産 | | 8,423 | 43,391 |
| 流動資産合計 | | 65,762,982 | 109,410,202 |
| 固定資産 | | | |
| 有形固定資産 | ※1 | | |
| 建物 | | 1,361,305 | 1,265,924 |
| 器具備品 | | 559,057 | 516,485 |
| 土地 | | 710 | 710 |
| リース資産 | | 4,114 | 1,782 |
| 建設仮勘定 | | 81,240 | － |
| 有形固定資産合計 | | 2,006,427 | 1,784,901 |
| 無形固定資産 | | | |
| ソフトウェア | | 2,414,295 | 2,606,617 |
| ソフトウェア仮勘定 | | 508,956 | 101,101 |
| のれん | | 3,045,409 | 2,740,868 |
| 顧客関連資産 | | 11,445,340 | 9,332,065 |
| 電話加入権 | | 12,706 | 12,706 |
| 商標権 | | 36 | 30 |
| 無形固定資産合計 | | 17,426,744 | 14,793,389 |
| 投資その他の資産 | | | |
| 投資有価証券 | | 9,222,276 | 9,976,957 |
| 関係会社株式 | | 11,850,598 | 1,927,221 |
| 長期差入保証金 | | 1,388,987 | 1,361,654 |
| 長期前払費用 | | 80,207 | 44,009 |
| 会員権 | | 90,479 | 90,479 |
| 繰延税金資産 | | － | 716,093 |
| 貸倒引当金 | | △ 20,750 | △ 20,750 |
| 投資その他の資産合計 | | 22,611,799 | 14,095,666 |
| 固定資産合計 | | 42,044,971 | 30,673,957 |
| 資産合計 | | 107,807,953 | 140,084,160 |

（単位：千円）

| | 前事業年度<br>(2023年3月31日) | 当事業年度<br>(2024年3月31日) |
|---|---|---|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| リース債務 | 2,564 | 1,960 |
| 顧客からの預り金 | 11,094 | 21,728 |
| その他の預り金 | 128,069 | 166,944 |
| 未払金 | | |
| 未払収益分配金 | 2,013 | 1,927 |
| 未払償還金 | 1,312 | 1,253 |
| 未払手数料 | 5,194,011 | 6,580,971 |
| その他未払金 | 259,542 | 642,514 |
| 未払費用 | 6,370,986 | 7,405,559 |
| 未払消費税等 | 406,770 | 937,155 |
| 未払法人税等 | 333,009 | 5,104,541 |
| 賞与引当金 | 1,801,492 | 2,854,060 |
| 資産除去債務 | 13,940 | － |
| その他の流動負債 | 73,657 | 17,443 |
| 流動負債合計 | 14,598,465 | 23,736,060 |
| 固定負債 | | |
| リース債務 | 1,960 | － |
| 繰延税金負債 | 550,493 | － |
| 退職給付引当金 | 5,027,832 | 4,941,989 |
| 固定負債合計 | 5,580,287 | 4,941,989 |
| 負債合計 | 20,178,752 | 28,678,050 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,000,000 | 2,000,000 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 8,628,984 | 8,628,984 |
| その他資本剰余金 | 73,466,962 | 73,466,962 |
| 資本剰余金合計 | 82,095,946 | 82,095,946 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 284,245 | 284,245 |
| その他利益剰余金 | | |
| 繰越利益剰余金 | 3,391,568 | 27,075,963 |
| 利益剰余金合計 | 3,675,814 | 27,360,208 |
| 株主資本計 | 87,771,760 | 111,456,155 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | △ 142,558 | △ 50,045 |
| 評価・換算差額等合計 | △ 142,558 | △ 50,045 |
| 純資産合計 | 87,629,201 | 111,406,109 |
| 負債・純資産合計 | 107,807,953 | 140,084,160 |

（2）【損益計算書】

（単位：千円）

| | 前事業年度<br>（自　2022年4月1日<br>至　2023年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2023年4月1日<br>至　2024年3月31日） |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 61,471,271 | 69,953,226 |
| 運用受託報酬 | 8,978,419 | 11,147,187 |
| 投資助言報酬 | 1,273,386 | 1,302,916 |
| その他営業収益 | | |
| サービス支援手数料 | 208,222 | 319,553 |
| その他 | 22,995 | 8,758 |
| 営業収益計 | 71,954,296 | 82,731,642 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 28,036,456 | 32,014,851 |
| 広告宣伝費 | 294,588 | 320,694 |
| 調査費 | | |
| 調査費 | 3,749,357 | 4,637,211 |
| 委託調査費 | 11,455,987 | 12,412,033 |
| 営業雑経費 | | |
| 通信費 | 61,068 | 56,291 |
| 印刷費 | 452,951 | 457,187 |
| 協会費 | 38,701 | 38,305 |
| 諸会費 | 33,447 | 30,484 |
| 情報機器関連費 | 5,067,617 | 5,268,275 |
| 販売促進費 | 29,621 | 31,339 |
| その他 | 197,696 | 253,344 |
| 営業費用合計 | 49,417,495 | 55,520,019 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | | |
| 役員報酬 | 219,872 | 232,329 |
| 給料・手当 | 7,807,797 | 8,043,456 |
| 賞与 | 1,042,472 | 1,073,375 |
| 賞与引当金繰入額 | 1,798,492 | 2,854,060 |
| 交際費 | 27,713 | 57,134 |
| 寄付金 | 25,518 | 26,400 |
| 事務委託費 | 1,727,189 | 2,022,734 |
| 旅費交通費 | 99,733 | 166,596 |
| 租税公課 | 352,030 | 600,468 |
| 不動産賃借料 | 1,268,303 | 1,249,392 |
| 退職給付費用 | 624,551 | 712,228 |
| 固定資産減価償却費 | 3,247,869 | 3,281,572 |
| のれん償却費 | 304,540 | 304,540 |
| 諸経費 | 200,758 | 215,455 |
| 一般管理費合計 | 18,746,845 | 20,839,745 |
| 営業利益 | 3,789,956 | 6,371,877 |

（単位：千円）

| | | 前事業年度<br>（自　2022年4月1日<br>至　2023年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2023年4月1日<br>至　2024年3月31日） |
|---|---|---|---|
| 営業外収益 | | | |
| 受取配当金 | | 1,755 | 11,021,392 |
| 受取利息 | | 1,373 | 2,840 |
| 金銭の信託運用益 | | － | 199,056 |
| 時効成立分配金・償還金 | | 521 | 461 |
| 原稿・講演料 | | 2,281 | 2,143 |
| 投資有価証券償還益 | | 119,033 | 5,384 |
| 投資有価証券売却益 | | 25,848 | 12,261 |
| 為替差益 | | 5,816 | － |
| 雑収入 | | 91,814 | 129,137 |
| 営業外収益合計 | | 248,443 | 11,372,678 |
| 営業外費用 | | | |
| 金銭の信託運用損 | | 454,339 | － |
| 投資有価証券償還損 | | 83,598 | 10,829 |
| 投資有価証券売却損 | | 152,691 | 48,575 |
| 為替差損 | | － | 4,701 |
| 営業外費用合計 | | 690,629 | 64,106 |
| 経常利益 | | 3,347,770 | 17,680,450 |
| 特別利益 | | | |
| 子会社株式売却益 | ※1 | － | 14,096,622 |
| 特別利益合計 | | － | 14,096,622 |
| 特別損失 | | | |
| 固定資産除却損 | ※2 | 13,203 | 12,385 |
| 早期退職費用 | ※3 | 126,832 | － |
| 支払補償費 | ※4 | 30,075 | － |
| 特別損失合計 | | 170,111 | 12,385 |
| 税引前当期純利益 | | 3,177,659 | 31,764,687 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 1,622,064 | 7,802,794 |
| 法人税等調整額 | | △ 541,433 | △ 1,314,394 |
| 法人税等合計 | | 1,080,631 | 6,488,400 |
| 当期純利益 | | 2,097,028 | 25,276,287 |

（3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2022年4月1日　至　2023年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益剰余金 | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | 利益準備金 | その他利益剰余金 |
| | | | | | | 繰越利益剰余金 |
| 当期首残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 73,466,962 | 82,095,946 | 284,245 | 3,834,794 |
| 当期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | △ 2,540,254 |
| 当期純利益 | | | | | | 2,097,028 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | | | | | | |
| 当期変動額合計 | － | － | － | － | － | △ 443,225 |
| 当期末残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 73,466,962 | 82,095,946 | 284,245 | 3,391,568 |

| | 株主資本 | | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|---|---|---|---|---|---|
| | 利益剰余金 | 株主資本合計 | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| | 利益剰余金合計 | | | | |
| 当期首残高 | 4,119,040 | 88,214,986 | 297,138 | 297,138 | 88,512,124 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | △ 2,540,254 | △ 2,540,254 | | | △ 2,540,254 |
| 当期純利益 | 2,097,028 | 2,097,028 | | | 2,097,028 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | | | △ 439,697 | △ 439,697 | △ 439,697 |
| 当期変動額合計 | △ 443,225 | △ 443,225 | △ 439,697 | △ 439,697 | △ 882,923 |
| 当期末残高 | 3,675,814 | 87,771,760 | △ 142,558 | △ 142,558 | 87,629,201 |

当事業年度（自　2023年4月1日　至　2024年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益剰余金 | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | 利益準備金 | その他利益剰余金 |
| | | | | | | 繰越利益剰余金 |
| 当期首残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 73,466,962 | 82,095,946 | 284,245 | 3,391,568 |
| 当期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | △ 1,591,892 |
| 当期純利益 | | | | | | 25,276,287 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | | | | | | |
| 当期変動額合計 | － | － | － | － | － | 23,684,394 |
| 当期末残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 73,466,962 | 82,095,946 | 284,245 | 27,075,963 |

| | 株主資本 | | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|---|---|---|---|---|---|
| | 利益剰余金 | 株主資本合計 | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| | 利益剰余金合計 | | | | |
| 当期首残高 | 3,675,814 | 87,771,760 | △ 142,558 | △ 142,558 | 87,629,201 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | △ 1,591,892 | △ 1,591,892 | | | △ 1,591,892 |
| 当期純利益 | 25,276,287 | 25,276,287 | | | 25,276,287 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | | | 92,513 | 92,513 | 92,513 |
| 当期変動額合計 | 23,684,394 | 23,684,394 | 92,513 | 92,513 | 23,776,908 |
| 当期末残高 | 27,360,208 | 111,456,155 | △ 50,045 | △ 50,045 | 111,406,109 |

[注記事項]

(重要な会計方針)
1.重要な資産の評価基準及び評価方法
(1)有価証券
①子会社株式
移動平均法による原価法

②その他有価証券
市場価格のない株式等以外
決算日の市場価格等に基づく時価法
(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)
市場価格のない株式等
移動平均法による原価法
投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資(金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの)
組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

(2)金銭の信託
運用目的の金銭の信託:時価法

2.固定資産の減価償却の方法
(1)有形固定資産(リース資産を除く)
定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。
なお、主な耐用年数は次のとおりであります。
建物 8～30年
器具備品 4～15年

(2)無形固定資産(リース資産を除く)
定額法によっております。
なお、主な償却年数は次のとおりであります。
のれん 14年
顧客関連資産 6～19年
ソフトウェア(自社利用分) 5年

(3)リース資産
所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産
リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3.引当金の計上基準
(1)貸倒引当金
債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2)賞与引当金
従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当事業年度の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金
従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度において発生していると認められる額を計上しております。
①退職給付見込額の期間帰属方法
退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法
過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。
数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4.収益及び費用の計上基準
当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び収益を認識する通常の時点は以下のとおりであります。
(1)委託者報酬
委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2)運用受託報酬
運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3)投資助言報酬
投資助言報酬は、対象顧客との投資助言契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の助言期間にわたり収益として認識しております。

(貸借対照表関係)
※1 有形固定資産の減価償却累計額

| | 前事業年度<br>(2023年3月31日) | 当事業年度<br>(2024年3月31日) |
|---|---|---|
| 建物 | 301,463千円 | 397,568千円 |
| 器具備品 | 1,499,284千円 | 1,493,885千円 |
| リース資産 | 7,493千円 | 9,824千円 |

2 当座借越契約
当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

| | 前事業年度<br>(2023年3月31日) | 当事業年度<br>(2024年3月31日) |
|---|---|---|
| 当座借越極度額の総額 | 10,000,000千円 | 10,000,000千円 |
| 借入実行残高 | －千円 | －千円 |
| 差引額 | 10,000,000千円 | 10,000,000千円 |

3 保証債務
前事業年度は、当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。
当事業年度は、該当事項はありません。

| | 前事業年度<br>(2023年3月31日) | 当事業年度<br>(2024年3月31日) |
|---|---|---|
| Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA)Inc. | 12,514千円 | －千円 |

(損益計算書関係)
※1 子会社売却益
日興グローバルラップ株式会社の株式を譲渡したことによる売却益であります。

※2　固定資産除却損

| | 前事業年度<br>（自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日） | 当事業年度<br>（自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日） |
|---|---|---|
| 建物 | 2,482千円 | 9,039千円 |
| 器具備品 | 4,273千円 | 2,987千円 |
| リース資産 | 532千円 | －千円 |
| ソフトウェア | 5,915千円 | 358千円 |

※3　早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

※4　支払補償費

受益者や販売会社に生じた損失の補償に伴い発生する費用であります。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2022年4月1日　至 2023年3月31日）

1．発行済株式数に関する事項

| | 当期首株式数 | 当期増加株式数 | 当期減少株式数 | 当期末株式数 |
|---|---|---|---|---|
| 普通株式 | 33,870,060株 | － | － | 33,870,060株 |

2．剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額<br>（千円） | 一株当たり<br>配当額（円） | 基準日 | 効力発生日 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2022年6月28日<br>定時株主総会 | 普通株式 | 2,540,254 | 75.00 | 2022年<br>3月31日 | 2022年<br>6月29日 |

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額<br>（千円） | 一株当たり<br>配当額（円） | 基準日 | 効力発生日 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2023年6月28日<br>定時株主総会 | 普通株式 | 1,591,892 | 47.00 | 2023年<br>3月31日 | 2023年<br>6月29日 |

当事業年度（自 2023年4月1日　至 2024年3月31日）

1．発行済株式数に関する事項

| | 当期首株式数 | 当期増加株式数 | 当期減少株式数 | 当期末株式数 |
|---|---|---|---|---|
| 普通株式 | 33,870,060株 | － | － | 33,870,060株 |

2．剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額<br>（千円） | 一株当たり<br>配当額（円） | 基準日 | 効力発生日 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2023年6月28日<br>定時株主総会 | 普通株式 | 1,591,892 | 47.00 | 2023年<br>3月31日 | 2023年<br>6月29日 |

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額<br>（千円） | 一株当たり<br>配当額（円） | 基準日 | 効力発生日 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2024年6月26日<br>定時株主総会 | 普通株式 | 10,838,419 | 320.00 | 2024年<br>3月31日 | 2024年<br>6月27日 |

（リース取引関係）
オペレーティング・リース取引
（借主側）
オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

（単位：千円）

| | 前事業年度<br>（2023年3月31日） | 当事業年度<br>（2024年3月31日） |
|---|---|---|
| 1年以内 | 1,161,545 | 1,161,545 |
| 1年超 | 1,161,545 | － |
| 合計 | 2,323,090 | 1,161,545 |

（金融商品関係）
1．金融商品の状況に関する事項
(1)金融商品に対する取組方針
当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っており、当社が設定する投資信託の事業推進等を目的として、直接または特定金外信託を通じて当該投資信託を保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバディブ取引は行わない方針であります。
なお、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。
また、資金調達は行っておりません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク
営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。
金銭の信託及び投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。
営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制
①信用リスクの管理
当社は、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、営業債権について取引先毎の期日管理及び残高管理を行うとともに、その状況について取締役会に報告しています。
金銭の信託、投資有価証券及び子会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。
②市場リスクの管理
金銭の信託及び投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、経営企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。
なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。
また、特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、市場価格の変動リスクについて為替予約、株価指数先物、債券先物、スワップ取引などのデリバティブ取引により一部リスクヘッジしております。

2.金融商品の時価等に関する事項

当事業年度における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません（(注1) 参照)。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価格に近似することから、注記を省略しております。

前事業年度（2023年3月31日）

(単位：千円)

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|---|---|---|---|
| (1)金銭の信託 | 12,645,575 | 12,645,575 | － |
| (2)投資有価証券 | | | |
| ①その他有価証券 | 9,182,466 | 9,182,466 | － |
| 資産計 | 21,828,042 | 21,828,042 | － |

当事業年度（2024年3月31日）

(単位：千円)

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|---|---|---|---|
| (1)金銭の信託 | 23,435,831 | 23,435,831 | － |
| (2)投資有価証券 | | | |
| ①その他有価証券 | 9,292,678 | 9,292,678 | － |
| 資産計 | 32,728,510 | 32,728,510 | － |

(注1)市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

(単位：千円)

| 区分 | 前事業年度<br>(2023年3月31日) | 当事業年度<br>(2024年3月31日) |
|---|---|---|
| その他有価証券 | | |
| (1)非上場株式 | 39,809 | 40,370 |
| (2)組合出資金等 | － | 643,909 |
| 合計 | 39,809 | 684,279 |
| 子会社株式 | | |
| 非上場株式 | 11,850,598 | 1,927,221 |
| 合計 | 11,850,598 | 1,927,221 |

3.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。なお、時価算定会計基準適用指針 27-3 項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項」については記載しておりません。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価で貸借対照表に計上している金融商品

前事業年度（2023年3月31日）

(単位：千円)

| 区分 | 時価 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| (1)金銭の信託 | － | 12,645,575 | － | 12,645,575 |
| (2)投資有価証券 | | | | |
| ①その他有価証券 | － | 9,182,466 | － | 9,182,466 |
| 資産計 | － | 21,828,042 | － | 21,828,042 |

当事業年度（2024年3月31日）　　（単位：千円）

| 区分 | 時価 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| (1)金銭の信託 | － | 23,435,831 | － | 23,435,831 |
| (2)投資有価証券 | | | | |
| ①その他有価証券 | － | 9,292,678 | － | 9,292,678 |
| 資産計 | － | 32,728,510 | － | 32,728,510 |

時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

(1) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 投資有価証券①その他有価証券

投資有価証券は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格とは認められないため、公表されている基準価額又は取引金融機関から提示された価格により評価しております。

（有価証券関係）

1．子会社株式

前事業年度（2023年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　関係会社株式11,850,598千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2024年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　関係会社株式1,927,221千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2．その他有価証券

前事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|---|---|---|---|
| (1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | | | |
| 投資信託等 | 3,144,004 | 3,054,367 | 89,637 |
| 小計 | 3,144,004 | 3,054,367 | 89,637 |
| (2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| 投資信託等 | 6,038,462 | 6,295,278 | △256,815 |
| 小計 | 6,038,462 | 6,295,278 | △256,815 |
| 合計 | 9,182,466 | 9,349,645 | △167,178 |

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額　39,809千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2024年3月31日）

（単位：千円）

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|---|---|---|---|
| (1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | | | |
| 投資信託等 | 3,489,939 | 3,297,367 | 192,572 |
| 小計 | 3,489,939 | 3,297,367 | 192,572 |
| (2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| 投資信託等 | 5,802,739 | 6,025,562 | △222,822 |
| 小計 | 5,802,739 | 6,025,562 | △222,822 |
| 合計 | 9,292,678 | 9,322,929 | △30,250 |

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額　684,279千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

３．事業年度中に売却したその他有価証券
前事業年度(自 2022 年４月１日　至 2023 年３月 31 日)

(単位：千円)

| 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|---|---|---|
| 1,675,637 | 25,848 | 152,691 |

(単位：千円)

| 償還額 | 償還益の合計額 | 償還損の合計額 |
|---|---|---|
| 6,449,143 | 119,033 | 83,598 |

当事業年度(自 2023 年４月１日　至 2024 年３月 31 日)

(単位：千円)

| 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|---|---|---|
| 801,686 | 12,261 | 48,575 |

(単位：千円)

| 償還額 | 償還益の合計額 | 償還損の合計額 |
|---|---|---|
| 217,908 | 5,384 | 10,829 |

(退職給付関係)
１．採用している退職給付制度の概要
当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

２．確定給付制度
(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

| | 前事業年度<br>(自 2022 年４月１日<br>至 2023 年３月 31 日) | 当事業年度<br>(自 2023 年４月１日<br>至 2024 年３月 31 日) |
|---|---|---|
| 退職給付債務の期首残高 | 5,084,506 | 5,027,832 |
| 勤務費用 | 429,188 | 423,516 |
| 利息費用 | 6,502 | 11,432 |
| 数理計算上の差異の発生額 | △12,781 | △34,405 |
| 退職給付の支払額 | △479,583 | △466,321 |
| 過去勤務費用の発生額 | － | △20,064 |
| 退職給付債務の期末残高 | 5,027,832 | 4,941,989 |

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

| | 前事業年度<br>(2023 年３月 31 日) | 当事業年度<br>(2024 年３月 31 日) |
|---|---|---|
| 非積立型制度の退職給付債務 | 5,027,832 | 4,941,989 |
| 未認識数理計算上の差異 | － | － |
| 未認識過去勤務費用 | － | － |
| 退職給付引当金 | 5,027,832 | 4,941,989 |

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

| | 前事業年度<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|---|---|---|
| 勤務費用 | 429,188 | 423,516 |
| 利息費用 | 6,502 | 11,432 |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | △12,781 | △34,405 |
| 過去勤務費用の費用処理額 | － | △20,064 |
| その他 | △39,914 | 67,197 |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 382,994 | 447,675 |

(注) その他は、その他の関係会社等からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金であります。

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

| | 前事業年度<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|---|---|---|
| 割引率 | 0.230% | 0.440% |

3．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度241,556千円、当事業年度264,552千円であります。

(税効果会計関係)

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

| | 前事業年度<br>(2023年3月31日) | 当事業年度<br>(2024年3月31日) |
|---|---|---|
| 繰延税金資産 | | |
| 退職給付引当金 | 1,539,522 | 1,513,237 |
| 賞与引当金 | 551,617 | 873,913 |
| 調査費 | 473,972 | 558,908 |
| 未払金 | 211,439 | 176,993 |
| 未払事業税 | 39,995 | 365,090 |
| ソフトウェア償却 | 105,506 | 101,113 |
| 子会社株式評価損 | 114,876 | 114,876 |
| その他有価証券評価差額金 | 120,350 | 109,942 |
| その他 | 21,158 | 18,064 |
| 繰延税金資産小計 | 3,178,439 | 3,832,139 |
| 評価性引当額 | △ 193,662 | △198,503 |
| 繰延税金資産合計 | 2,984,776 | 3,633,635 |
| 繰延税金負債 | | |
| 無形固定資産 | 3,504,563 | 2,857,478 |
| 資産除去債務 | 3,201 | － |
| その他有価証券評価差額金 | 27,506 | 60,063 |
| 繰延税金負債合計 | 3,535,270 | 2,917,542 |
| 繰延税金資産（負債）の純額 | △550,493 | 716,093 |

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

| | 前事業年度<br>(2023年3月31日) | 当事業年度<br>(2024年3月31日) |
|---|---|---|
| 法定実効税率 | 30.6% | 30.6% |
| (調整) | | |
| 受取配当等永久に益金に算入されない項目 | △0.0 | △10.6 |
| のれん償却費 | 2.9 | 0.2 |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 3.0 | 0.1 |
| 所得税額控除による税額控除 | △1.3 | － |
| その他 | △1.2 | 0.0 |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 34.0 | 20.4 |

(収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1.セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

| | 委託者報酬 | 運用受託報酬 | 投資助言報酬 | その他 | 合計 |
|---|---|---|---|---|---|
| 外部顧客への営業収益 | 61,471,271 | 8,978,419 | 1,273,386 | 231,218 | 71,954,296 |

(2)地域ごとの情報

①営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の 90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

②有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の 90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2023年4月1日 至2024年3月31日)

1.セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位:千円)

| | 委託者報酬 | 運用受託報酬 | 投資助言報酬 | その他 | 合計 |
|---|---|---|---|---|---|
| 外部顧客への営業収益 | 69,953,226 | 11,147,187 | 1,302,916 | 328,311 | 82,731,642 |

(2)地域ごとの情報

①営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の 90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

②有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の 90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1.関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位:千円)

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金、出資金又は基金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 親会社の子会社 | (株)三井住友銀行 | 東京都千代田区 | 1,770,996,505 | 銀行業 | % － | 投信の販売委託 役員の兼任 | 委託販売手数料 | 5,279,199 | 未払手数料 | 1,265,651 |
| 親会社の子会社 | SMBC 日興証券(株) | 東京都千代田区 | 10,000,000 | 証券業 | % － | 投信の販売委託 役員の兼任 | 委託販売手数料 | 7,030,381 | 未払手数料 | 1,288,749 |

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2.親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ(東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1．関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金、出資金又は基金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 親会社の子会社 | ㈱三井住友銀行 | 東京都千代田区 | 1,770,996,505 | 銀行業 | %<br>― | 投信の販売委託<br>役員の兼任 | 委託販売手数料 | 6,642,605 | 未払手数料 | 1,630,250 |
| 親会社の子会社 | SMBC 日興証券㈱ | 東京都千代田区 | 135,000,000 | 証券業 | %<br>― | 投信の販売委託<br>役員の兼任 | 委託販売手数料 | 6,960,278 | 未払手数料 | 1,200,878 |

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2．親会社に関する注記

(単位：千円)

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金、出資金又は基金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 親会社 | ㈱三井住友フィナンシャルグループ | 東京都千代田区 | 2,344,038,000 | 銀行業 | 50.1% | 持株会社 | 子会社株式の売却(売却価格) | 24,000,000 | ― | ― |
| | | | | | | | 子会社株式売却益 | 14,096,622 | | |

(注) 子会社株式の売却及び子会社株式売却益

取引価額については、企業価値を勘案し、両社協議のうえ合理的に決定しております。

(1株当たり情報)

| | 前事業年度<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|---|---|---|
| 1株当たり純資産額 | 2,587.21円 | 3,289.22円 |
| 1株当たり当期純利益 | 61.91円 | 746.27円 |

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、次のとおりであります。

| | 前事業年度<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2023年4月1日<br>至 2024年3月31日) |
|---|---|---|
| 1株当たり当期純利益 | | |
| 当期純利益（千円） | 2,097,028 | 25,276,287 |
| 普通株主に帰属しない金額（千円） | ― | ― |
| 普通株式に係る当期純利益（千円） | 2,097,028 | 25,276,287 |
| 期中平均株式数（株） | 33,870,060 | 33,870,060 |

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

| | | 第40期中間会計期間<br>(2024年9月30日) |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | | 47,554,844 |
| 金銭の信託 | | 32,385,266 |
| 顧客分別金信託 | | 500,088 |
| 前払費用 | | 668,897 |
| 未収委託者報酬 | | 14,766,695 |
| 未収運用受託報酬 | | 3,912,269 |
| 未収投資助言報酬 | | 414,955 |
| 未収収益 | | 95,923 |
| その他 | | 107,185 |
| 流動資産合計 | | 100,406,126 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | ※1 | 1,723,779 |
| 無形固定資産 | | |
| のれん | | 2,588,598 |
| 顧客関連資産 | | 8,275,427 |
| その他 | | 2,669,494 |
| 無形固定資産合計 | | 13,533,520 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | | 8,628,900 |
| 関係会社株式 | | 1,927,221 |
| 繰延税金資産 | | 851,984 |
| その他 | | 1,484,455 |
| 貸倒引当金 | | △20,750 |
| 投資その他の資産合計 | | 12,871,811 |
| 固定資産合計 | | 28,129,111 |
| 資産合計 | | 128,535,237 |
| | | |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 顧客からの預り金 | | 35,815 |
| その他の預り金 | | 102,081 |
| 未払金 | | 6,905,143 |
| 未払費用 | | 6,996,236 |
| 未払法人税等 | | 1,639,174 |
| 前受収益 | | 20,339 |
| 賞与引当金 | | 2,605,528 |
| その他 | ※2 | 864,362 |
| 流動負債合計 | | 19,168,682 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | | 5,101,556 |
| 固定負債合計 | | 5,101,556 |

| | |
|---|---|
| 負債合計 | 24,270,238 |
| | |
| 純資産の部 | |
| 株主資本 | |
| 資本金 | 2,000,000 |
| 資本剰余金 | |
| 資本準備金 | 8,628,984 |
| その他資本剰余金 | 73,466,962 |
| 資本剰余金合計 | 82,095,946 |
| 利益剰余金 | |
| 利益準備金 | 284,245 |
| その他利益剰余金 | |
| 繰越利益剰余金 | 19,992,998 |
| 利益剰余金合計 | 20,277,244 |
| 株主資本合計 | 104,373,190 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | △108,191 |
| 評価・換算差額等合計 | △108,191 |
| 純資産合計 | 104,264,998 |
| 負債純資産合計 | 128,535,237 |

(2) 中間損益計算書

（単位：千円）

| | | 第40期中間会計期間<br>（自　2024年4月1日<br>至　2024年9月30日） |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | | 38,900,518 |
| 運用受託報酬 | | 5,763,952 |
| 投資助言報酬 | | 699,359 |
| その他の営業収益 | | 206,638 |
| 営業収益計 | | 45,570,468 |
| 営業費用 | | 30,344,119 |
| 一般管理費 | ※1 | 10,363,314 |
| 営業利益 | | 4,863,035 |
| 営業外収益 | ※2 | 482,490 |
| 営業外費用 | ※3 | 179,370 |
| 経常利益 | | 5,166,155 |
| 特別損失 | ※4 | 0 |
| 税引前中間純利益 | | 5,166,155 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 1,475,655 |
| 法人税等調整額 | | △64,954 |
| 法人税等合計 | | 1,410,700 |
| 中間純利益 | | 3,755,454 |

(3) 中間株主資本等変動計算書

第40期中間会計期間（自　2024年4月1日　至　2024年9月30日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益剰余金 | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | 利益準備金 | その他利益剰余金<br>繰越利益剰余金 |
| 当期首残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 73,466,962 | 82,095,946 | 284,245 | 27,075,963 |
| 当中間期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | △10,838,419 |
| 中間純利益 | | | | | | 3,755,454 |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | | | | | | |
| 当中間期変動額合計 | － | － | － | － | － | △ 7,082,964 |
| 当中間期末残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 73,466,962 | 82,095,946 | 284,245 | 19,992,998 |

| | 株主資本 | | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|---|---|---|---|---|---|
| | 利益剰余金<br>利益剰余金合計 | 株主資本合計 | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 27,360,208 | 111,456,155 | △50,045 | △50,045 | 111,406,109 |
| 当中間期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | △10,838,419 | △10,838,419 | | | △10,838,419 |
| 中間純利益 | 3,755,454 | 3,755,454 | | | 3,755,454 |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | | | △58,146 | △58,146 | △58,146 |
| 当中間期変動額合計 | △7,082,964 | △7,082,964 | △58,146 | △58,146 | △7,141,110 |
| 当中間期末残高 | 20,277,244 | 104,373,190 | △108,191 | △108,191 | 104,264,998 |

注記事項

（重要な会計方針）

１．資産の評価基準及び評価方法

⑴有価証券

①子会社株式

移動平均法による原価法

②その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資（金融商品取引法第２条第２項により有価証券とみなされるもの）

組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

⑵金銭の信託

運用目的の金銭の信託

時価法

２．固定資産の減価償却の方法

⑴有形固定資産（リース資産を除く）

定率法によっております。但し、建物（建物附属設備を除く）並びに2016年４月１日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

| | |
|---|---|
| 建物 | 8～30年 |
| 器具備品 | 4～15年 |

⑵無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

| | |
|---|---|
| のれん | 14年 |
| 顧客関連資産 | 6～19年 |
| ソフトウェア（自社利用分） | 5年 |

⑶リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

３．引当金の計上基準

⑴貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

⑵賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当中間会計期間の負担額を計上しております。

⑶退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間において発生していると認められる額を計上しております。

①退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

４．収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び収益を認識する通常の時点は以下のとおりであります。

(1)委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2)運用受託報酬

運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3)投資助言報酬

投資助言報酬は、対象顧客との投資助言契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の助言期間にわたり収益として認識しております。

(中間貸借対照表関係)

| 第40期中間会計期間<br>(2024年9月30日) |
|---|
| ※1.有形固定資産の減価償却累計額<br>1,996,227千円 |
| ※2.消費税等の取扱い<br>仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。 |
| ※3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。<br>当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。<br>当座借越極度額の総額　10,000,000千円<br>借入実行残高　－<br>差引額　10,000,000千円 |

(中間損益計算書関係)

| 第40期中間会計期間<br>(自　2024年4月1日　至　2024年9月30日) |
|---|
| ※1.一般管理費のうち主要なもの<br>のれん償却費　152,270千円<br>減価償却実施額<br>有形固定資産　134,998千円<br>無形固定資産　1,537,662千円 |
| ※2.営業外収益のうち主要なもの<br>受取配当金　387,174千円<br>投資有価証券売却益　798千円<br>為替差益　6,926千円 |
| ※3.営業外費用のうち主要なもの<br>金銭の信託運用損　11,765千円<br>投資有価証券償還損　124,882千円<br>投資有価証券売却損　93千円<br>投資事業組合運用損　42,628千円 |
| ※4.特別損失のうち主要なもの<br>固定資産除却損　0千円 |

（中間株主資本等変動計算書関係）

第40期中間会計期間（自　2024年4月1日　至　2024年9月30日）

１．発行済株式数に関する事項

| | 当事業年度期首株式数 | 当中間会計期間増加株式数 | 当中間会計期間減少株式数 | 当中間会計期間末株式数 |
|---|---|---|---|---|
| 普通株式 | 33,870,060株 | － | － | 33,870,060株 |

２．剰余金の配当に関する事項

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額（千円） | 一株当たり配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2024年6月26日定時株主総会 | 普通株式 | 10,838,419 | 320.00 | 2024年3月31日 | 2024年6月27日 |

（リース取引関係）

| 第40期中間会計期間<br>（自　2024年4月1日　至　2024年9月30日） |
|---|
| １．オペレーティング・リース取引<br>(借主側)<br>未経過リース料（解約不能のもの）<br>１年以内　1,145,406千円<br>１年超　5,081,701千円<br>合　計　6,227,108千円 |

（金融商品関係）

１．金融商品の時価等に関する事項

第40期中間会計期間（2024年9月30日）

2024年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません（(注1）参照)。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。

（単位：千円）

| 区分 | 中間貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|---|---|---|---|
| (1)金銭の信託 | 32,385,266 | 32,385,266 | － |
| (2)投資有価証券 | | | |
| ①その他有価証券 | 7,511,892 | 7,511,892 | － |
| 資産計 | 39,897,158 | 39,897,158 | － |

(注1）市場価格のない金融商品

（単位：千円）

| 区分 | 中間貸借対照表計上額 |
|---|---|
| その他有価証券 | |
| (1)非上場株式 | 40,367 |
| (2)組合出資金等 | 1,076,640 |
| 合計 | 1,117,008 |
| 子会社株式 | |
| 非上場株式 | 1,927,221 |
| 合計 | 1,927,221 |

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日）第5項に従い、1．金融商品の時価等に関する事項及び2．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

２．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の３つのレベルに分類しております。

レベル１の時価 ： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル２の時価 ： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル１のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル３の時価 ： 観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品　（単位：千円）

| 区分 | 時価 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | レベル１ | レベル２ | レベル３ | 合計 |
| (1)金銭の信託 | － | 32,385,266 | － | 32,385,266 |
| (2)投資有価証券 | | | | |
| ①その他有価証券 | － | 7,511,892 | － | 7,511,892 |
| 資産計 | － | 39,897,158 | － | 39,897,158 |

（注１）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

(1) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 投資有価証券①その他有価証券

投資有価証券は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格とは認められないため、公表されている基準価額又は取引金融機関から提示された価格により評価しております。

（有価証券関係）

第40期中間会計期間（2024年9月30日）

１．子会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額　1,927,221千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

２．その他有価証券

（単位：千円）

| 区分 | 中間貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|---|---|---|---|
| (1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | | | |
| 投資信託等 | 3,313,926 | 3,300,367 | 13,559 |
| 小計 | 3,313,926 | 3,300,367 | 13,559 |
| (2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| 投資信託等 | 4,197,965 | 4,313,296 | △115,330 |
| 小計 | 4,197,965 | 4,313,296 | △115,330 |
| 合計 | 7,511,892 | 7,613,663 | △101,770 |

（注）組合出資金等（中間貸借対照表計上額　1,117,008千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（収益認識関係）

第40期中間会計期間（自　2024年4月1日　至　2024年9月30日）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

（セグメント情報等）

第40期中間会計期間（自　2024年4月1日　至　2024年9月30日）

１．セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

２．関連情報

⑴製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

| | 委託者報酬 | 運用受託報酬 | 投資助言報酬 | その他 | 合計 |
|---|---|---|---|---|---|
| 外部顧客への営業収益 | 38,900,518 | 5,763,952 | 699,359 | 206,638 | 45,570,468 |

⑵地域ごとの情報

①営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の 90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

②有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の 90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

⑶主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

３．報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

４．報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

５．報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

| 第40期中間会計期間<br>（自　2024年4月1日　至　2024年9月30日） |
|---|
| １株当たり純資産額　3,078円38銭<br>１株当たり中間純利益　110円87銭<br><br>なお、潜在株式調整後１株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 |

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

イ　自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

ロ　運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

ハ　通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

ニ　委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

ホ　上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

イ　定款の変更、その他の重要事項

（イ）定款の変更

該当ありません。

（ロ）その他の重要事項

該当ありません。

ロ　訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

# 追加型証券投資信託
# 三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）
# 約款

三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社

## 〔運用の基本方針〕

信託約款第19条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は以下の通りとします。

１．基本方針

この投資信託は、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

別に定める投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主として別に定める投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。

・主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券に投資します。

・別に定める投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

② イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

・基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

③ 実質組入外貨建資産については、別に定める投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

④ 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

⑤ 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

① 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

② 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

③ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

④ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

３．収益分配方針

年１回（原則として毎年９月15日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

① 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。

② 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託者の判断により分配を行わないことがあります。

③ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

# 追加型証券投資信託
# 『三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）』
# 〔信託約款〕

**【信託の種類、委託者および受託者】**

第１条　この信託は、証券投資信託であり、三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

②　この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

**【信託事務の委託】**

第２条　受託者は、信託法第28条第１号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第１条第１項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第２条第１項にて準用する信託業法第29条第２項第１号に規定する利害関係人をいいます。以下この条、第18条第１項および第２項、第23条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②　前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

**【信託の目的および金額】**

第３条　委託者は、金2,000,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

**【信託金の限度額】**

第４条　委託者は、受託者と合意の上、金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②　委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

**【信託期間】**

第５条　この信託の期間は、信託契約締結日から第41条第１項、第42条第１項、第43条第１項、第45条第２項による信託終了の日までとします。

**【受益権の取得申込みの勧誘の種類】**

第６条　この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第２条第３項第１号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第８項で定める公募により行われます。

**【当初の受益者】**

第７条　この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第８条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

**【受益権の分割および再分割】**

第８条　委託者は、第３条の規定による受益権については2,000,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第９条第１項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②　委託者は、受託者と協議の上、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

**【追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法】**

第９条　追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②　この信託約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（第20条に規定する借入れ公社債を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

③　第22条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

**【信託日時の異なる受益権の内容】**

第10条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

**【受益権の帰属と受益証券の不発行】**

第11条　この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第２条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③ 委託者は、第８条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

**【受益権の設定にかかる受託者の通知】**

第12条　受託者は、第３条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

**【受益権の申込単位および価額】**

第13条　指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第１項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第２条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第８条第１項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、当該指定販売会社がそれぞれ別に定める単位をもって取得申込みに応じることができるものとします。

② 前項の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第３項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

③ 第１項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みにかかる受益権の価額は、１口につき１円に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。

④ 前項の規定にかかわらず、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第31条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑤ 前各項の規定にかかわらず、指定販売会社は、この信託契約締結日以降において、取得申込日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、当該取得申込みに応じません。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付けを中止することおよび既に受け付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

⑦ この信託約款において取引所とは金融商品取引法第２条第17項に規定する取引所金融商品市場および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

**【受益権の譲渡にかかる記載または記録】**

第14条　受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記

載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設した者でない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③ 委託者は、第１項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

**【受益権の譲渡の対抗要件】**

第15条　受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

**【投資の対象とする資産の種類】**

第16条　この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

２．特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

イ．為替手形

**【運用の指図範囲等】**

第17条　委託者は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

２．外国または外国の者の発行する証券で、前号の性質を有するもの

３．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

なお、第３号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

１．預金

２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

③ 第１項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

**【利害関係人等との取引等】**

第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第23条第１項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第

16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の４第３項および同条第４項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④ 前３項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第３項および同法第32条第３項の通知は行いません。

**【運用の基本方針】**

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

**【公社債の借入れの指図】**

第20条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

② 前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④ 第１項の借入れにかかる品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

**【特別の場合の外貨建有価証券への投資制限】**

第21条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

**【外国為替予約取引の指図】**

第22条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（別に定める投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

② 前項において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する別に定める投資信託証券の時価総額に別に定める投資信託証券の信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

**【信託業務の委託等】**

第23条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第１項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合する者（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

１．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２．委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

３．委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること

４．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前２項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める

者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

１．信託財産の保存にかかる業務

２．信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

３．委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務

４．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

**【混蔵寄託】**

第24条　金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第２条第９項に規定するものをいいます。本条においては、外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者を含みます。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

**【信託財産の登記等および記載等の留保等】**

第25条　信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②　前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③　信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④　動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

**【一部解約の請求および有価証券の売却等の指図】**

第26条　委託者は、信託財産に属する投資信託証券にかかる信託契約の一部解約の実行請求ならびに有価証券の売却等の指図ができます。

**【再投資の指図】**

第27条　委託者は、前条の規定による一部解約の代金、有価証券の売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

**【資金の借入れ】**

第28条　委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

１．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内

２．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

３．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10％以内

③　収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

④　借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

**【損益の帰属】**

第29条　委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

**【受託者による資金の立替え】**

第30条　信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②　信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。

③　前２項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

**【信託の計算期間】**

第31条　この信託の計算期間は、毎年９月16日から翌年９月15日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は平成29年９月14日から平成30年９月18日までとします。

②　前項の規定にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第５条に規定する信託期間の終了日とします。

**【信託財産に関する報告等】**

第32条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②　受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③　受託者は、前２項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第３項に定める報告は行わないこととします。

④　受益者は、受託者に対し、信託法第37条第２項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第１項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

**【信託事務等の諸費用】**

第33条　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部（消費税等相当額を含みます。）および受託者の立て替えた立替金の利息等（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②　前項の信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部については、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、固定率または固定金額にて計算した額を、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁するものとします。

**【信託報酬等の額】**

第34条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の88の率を乗じて得た額とします。

②　前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③　第１項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

**【収益の処理方法】**

第35条　信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

１．配当金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

２．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②　毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

**【収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責】**

第36条　受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第37条第３項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第37条第４項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

**【収益分配金、償還金および一部解約金の支払いならびに収益分配金の再投資】**

第37条　収益分配金は、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める「累積投資約款」に従った契約（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、その場合は、当該別の名称に読み替えるものとします。）に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第３項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

④ 一部解約金は、第39条第１項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として６営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第２項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。なお、「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。また、「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。

**【収益分配金および償還金の時効】**

第38条　受益者が、収益分配金については前条第１項に規定する支払開始日から５年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第３項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

**【信託契約の一部解約】**

第39条　受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に１口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、一部解約の実行の請求日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、当該一部解約の実行の請求を受け付けません。

③ 委託者は、第１項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第１項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機

関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。

⑤ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

⑥ 委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第１項による一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。

⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止前に行った実行されていない一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第４項の規定に準じて算出した価額とします。

**【質権口記載または記録の受益権の取扱い】**

第40条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

**【信託契約の解約】**

第41条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④ 第２項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

⑤ 第２項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第２項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

**【信託契約に関する監督官庁の命令】**

第42条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第46条の規定に従います。

**【委託者の登録取消等に伴う取扱い】**

第43条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第46条第２項の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

**【委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い】**

第44条　委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②　委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

**【受託者の辞任および解任に伴う取扱い】**

第45条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第46条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②　委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

**【信託約款の変更等】**

第46条　委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②　委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③　前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④　第２項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

⑤　書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥　第２項から前項までの規定は、委託者が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑦　前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

**【反対受益者の受益権買取請求の不適用】**

第47条　この信託は、受益者が第39条の規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託者が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第41条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第１項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

**【他の受益者の氏名等の開示の請求の制限】**

第48条　この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

**【信託期間の延長】**

第49条　＜削除＞

**【運用状況に係る情報の提供】**

第50条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第１項に定める事項に係る情報を電磁的方法により提供します。

②　前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から前項に定める情報の提供について、書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行うものとします。

**【公告】**

第51条　委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。
https://www.smd-am.co.jp

②　前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は日本経済新聞に掲載します。

**【信託約款に関する疑義の取扱い】**

第52条　この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成29年９月14日（信託契約締結日）

委託者　　東京都港区愛宕二丁目５番１号
三井住友アセットマネジメント株式会社
代表取締役　　松下　隆史

受託者　　東京都千代田区丸の内一丁目４番１号
三井住友信託銀行株式会社
取締役社長　　橋本　勝

## 〔付表〕

１．運用の基本方針および信託約款第17条第１項に規定する「別に定める投資信託証券」は下記のものとします。

親投資信託　国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）
親投資信託　外国株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　エマージング株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　Ｊリート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　外国リート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　国内債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　外国債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
米国籍米ドル建て投資信託　ｉシェアーズ　Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ

２．信託約款第13条第５項および第39条第２項に規定する「別に定める日」は下記のものとします。

・ニューヨークの取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日

# 追加型証券投資信託
# 三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）
# 約款

三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社

## 〔運用の基本方針〕

信託約款第19条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は以下の通りとします。

１．基本方針

この投資信託は、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

別に定める投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主として別に定める投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。

・主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券に投資します。

・別に定める投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

② イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

・基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

③ 実質組入外貨建資産については、別に定める投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

④ 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

⑤ 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

① 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

② 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

③ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

④ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

３．収益分配方針

年１回（原則として毎年９月15日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

① 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。

② 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託者の判断により分配を行わないことがあります。

③ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

# 追加型証券投資信託
# 『三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）』
# 〔信託約款〕

**【信託の種類、委託者および受託者】**

第１条　この信託は、証券投資信託であり、三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

②　この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

**【信託事務の委託】**

第２条　受託者は、信託法第28条第１号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第１条第１項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第２条第１項にて準用する信託業法第29条第２項第１号に規定する利害関係人をいいます。以下この条、第18条第１項および第２項、第23条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②　前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

**【信託の目的および金額】**

第３条　委託者は、金2,000,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

**【信託金の限度額】**

第４条　委託者は、受託者と合意の上、金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②　委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

**【信託期間】**

第５条　この信託の期間は、信託契約締結日から第41条第１項、第42条第１項、第43条第１項、第45条第２項による信託終了の日までとします。

**【受益権の取得申込みの勧誘の種類】**

第６条　この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第２条第３項第１号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第８項で定める公募により行われます。

**【当初の受益者】**

第７条　この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第８条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

**【受益権の分割および再分割】**

第８条　委託者は、第３条の規定による受益権については2,000,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第９条第１項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②　委託者は、受託者と協議の上、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

**【追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法】**

第９条　追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②　この信託約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（第20条に規定する借入れ公社債を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

③　第22条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

**【信託日時の異なる受益権の内容】**

第10条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

**【受益権の帰属と受益証券の不発行】**

第11条　この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第２条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③ 委託者は、第８条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

**【受益権の設定にかかる受託者の通知】**

第12条　受託者は、第３条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

**【受益権の申込単位および価額】**

第13条　指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第１項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第２条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第８条第１項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、当該指定販売会社がそれぞれ別に定める単位をもって取得申込みに応じることができるものとします。

② 前項の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第３項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

③ 第１項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みにかかる受益権の価額は、１口につき１円に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。

④ 前項の規定にかかわらず、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第31条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑤ 前各項の規定にかかわらず、指定販売会社は、この信託契約締結日以降において、取得申込日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、当該取得申込みに応じません。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付けを中止することおよび既に受け付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

⑦ この信託約款において取引所とは金融商品取引法第２条第17項に規定する取引所金融商品市場および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

**【受益権の譲渡にかかる記載または記録】**

第14条　受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記

載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設した者でない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③ 委託者は、第１項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

**【受益権の譲渡の対抗要件】**

第15条　受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

**【投資の対象とする資産の種類】**

第16条　この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

２．特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

イ．為替手形

**【運用の指図範囲等】**

第17条　委託者は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

２．外国または外国の者の発行する証券で、前号の性質を有するもの

３．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

なお、第３号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

１．預金

２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

③ 第１項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

**【利害関係人等との取引等】**

第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第23条第１項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第

16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の４第３項および同条第４項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④ 前３項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第３項および同法第32条第３項の通知は行いません。

**【運用の基本方針】**

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

**【公社債の借入れの指図】**

第20条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

② 前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④ 第１項の借入れにかかる品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

**【特別の場合の外貨建有価証券への投資制限】**

第21条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

**【外国為替予約取引の指図】**

第22条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（別に定める投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

② 前項において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する別に定める投資信託証券の時価総額に別に定める投資信託証券の信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

**【信託業務の委託等】**

第23条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第１項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合する者（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

１．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２．委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

３．委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること

４．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前２項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める

者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

１．信託財産の保存にかかる業務

２．信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

３．委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務

４．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

**【混蔵寄託】**

第24条　金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第２条第９項に規定するものをいいます。本条においては、外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者を含みます。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

**【信託財産の登記等および記載等の留保等】**

第25条　信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②　前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③　信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④　動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

**【一部解約の請求および有価証券の売却等の指図】**

第26条　委託者は、信託財産に属する投資信託証券にかかる信託契約の一部解約の実行請求ならびに有価証券の売却等の指図ができます。

**【再投資の指図】**

第27条　委託者は、前条の規定による一部解約の代金、有価証券の売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

**【資金の借入れ】**

第28条　委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

１．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内

２．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

３．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10％以内

③　収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

④　借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

**【損益の帰属】**

第29条　委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

**【受託者による資金の立替え】**

第30条　信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②　信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。

③　前２項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

**【信託の計算期間】**

第31条　この信託の計算期間は、毎年９月16日から翌年９月15日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は平成29年９月14日から平成30年９月18日までとします。

②　前項の規定にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第５条に規定する信託期間の終了日とします。

**【信託財産に関する報告等】**

第32条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②　受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③　受託者は、前２項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第３項に定める報告は行わないこととします。

④　受益者は、受託者に対し、信託法第37条第２項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第１項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

**【信託事務等の諸費用】**

第33条　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部（消費税等相当額を含みます。）および受託者の立て替えた立替金の利息等（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②　前項の信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部については、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、固定率または固定金額にて計算した額を、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁するものとします。

**【信託報酬等の額】**

第34条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の88の率を乗じて得た額とします。

②　前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③　第１項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

**【収益の処理方法】**

第35条　信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

１．配当金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

２．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②　毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

**【収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責】**

第36条　受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第37条第３項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第37条第４項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

**【収益分配金、償還金および一部解約金の支払いならびに収益分配金の再投資】**

第37条　収益分配金は、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める「累積投資約款」に従った契約（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、その場合は、当該別の名称に読み替えるものとします。）に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第３項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

④ 一部解約金は、第39条第１項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として６営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第２項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。なお、「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。また、「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。

**【収益分配金および償還金の時効】**

第38条　受益者が、収益分配金については前条第１項に規定する支払開始日から５年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第３項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

**【信託契約の一部解約】**

第39条　受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に１口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、一部解約の実行の請求日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、当該一部解約の実行の請求を受け付けません。

③ 委託者は、第１項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第１項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機

関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。

⑤ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

⑥ 委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第１項による一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。

⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止前に行った実行されていない一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第４項の規定に準じて算出した価額とします。

**【質権口記載または記録の受益権の取扱い】**

第40条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

**【信託契約の解約】**

第41条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④ 第２項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

⑤ 第２項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第２項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

**【信託契約に関する監督官庁の命令】**

第42条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第46条の規定に従います。

**【委託者の登録取消等に伴う取扱い】**

第43条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第46条第２項の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

**【委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い】**

第44条　委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②　委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

**【受託者の辞任および解任に伴う取扱い】**

第45条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第46条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②　委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

**【信託約款の変更等】**

第46条　委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②　委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③　前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④　第２項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

⑤　書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥　第２項から前項までの規定は、委託者が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑦　前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

**【反対受益者の受益権買取請求の不適用】**

第47条　この信託は、受益者が第39条の規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託者が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第41条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第１項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

**【他の受益者の氏名等の開示の請求の制限】**

第48条　この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

**【信託期間の延長】**

第49条　＜削除＞

**【運用状況に係る情報の提供】**

第50条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第１項に定める事項に係る情報を電磁的方法により提供します。

②　前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から前項に定める情報の提供について、書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行うものとします。

**【公告】**

第51条　委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。
https://www.smd-am.co.jp

②　前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は日本経済新聞に掲載します。

**【信託約款に関する疑義の取扱い】**

第52条　この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成29年９月14日（信託契約締結日）

委託者　　東京都港区愛宕二丁目５番１号
三井住友アセットマネジメント株式会社
代表取締役　　松下　隆史

受託者　　東京都千代田区丸の内一丁目４番１号
三井住友信託銀行株式会社
取締役社長　　橋本　勝

## 〔付表〕

１．運用の基本方針および信託約款第17条第１項に規定する「別に定める投資信託証券」は下記のものとします。

親投資信託　国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）
親投資信託　外国株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　エマージング株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　Ｊリート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　外国リート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　国内債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　外国債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
米国籍米ドル建て投資信託　ｉシェアーズ　Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ

２．信託約款第13条第５項および第39条第２項に規定する「別に定める日」は下記のものとします。

・ニューヨークの取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日

# 追加型証券投資信託
# 三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）
# 約款

三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社

## 〔運用の基本方針〕

信託約款第19条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は以下の通りとします。

１．基本方針

この投資信託は、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

別に定める投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主として別に定める投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。

・主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券に投資します。

・別に定める投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

② イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

・基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

③ 実質組入外貨建資産については、別に定める投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

④ 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

⑤ 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

① 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

② 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

③ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

④ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10％以内とします。

⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10％、合計で20％以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

３．収益分配方針

年１回（原則として毎年９月15日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

① 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。

② 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託者の判断により分配を行わないことがあります。

③ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

# 追加型証券投資信託
# 『三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型)』
# 〔信託約款〕

**【信託の種類、委託者および受託者】**

第１条　この信託は、証券投資信託であり、三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

②　この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

**【信託事務の委託】**

第２条　受託者は、信託法第28条第１号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第１条第１項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第２条第１項にて準用する信託業法第29条第２項第１号に規定する利害関係人をいいます。以下この条、第18条第１項および第２項、第23条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②　前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

**【信託の目的および金額】**

第３条　委託者は、金2,000,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

**【信託金の限度額】**

第４条　委託者は、受託者と合意の上、金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②　委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

**【信託期間】**

第５条　この信託の期間は、信託契約締結日から第41条第１項、第42条第１項、第43条第１項、第45条第２項による信託終了の日までとします。

**【受益権の取得申込みの勧誘の種類】**

第６条　この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第２条第３項第１号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第８項で定める公募により行われます。

**【当初の受益者】**

第７条　この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第８条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

**【受益権の分割および再分割】**

第８条　委託者は、第３条の規定による受益権については2,000,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第９条第１項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②　委託者は、受託者と協議の上、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

**【追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法】**

第９条　追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②　この信託約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（第20条に規定する借入れ公社債を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

③　第22条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

**【信託日時の異なる受益権の内容】**

第10条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

**【受益権の帰属と受益証券の不発行】**

第11条　この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第２条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③ 委託者は、第８条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

**【受益権の設定にかかる受託者の通知】**

第12条　受託者は、第３条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

**【受益権の申込単位および価額】**

第13条　指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第１項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第２条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第８条第１項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、当該指定販売会社がそれぞれ別に定める単位をもって取得申込みに応じることができるものとします。

② 前項の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第３項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

③ 第１項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みにかかる受益権の価額は、１口につき１円に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。

④ 前項の規定にかかわらず、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第31条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑤ 前各項の規定にかかわらず、指定販売会社は、この信託契約締結日以降において、取得申込日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、当該取得申込みに応じません。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付けを中止することおよび既に受け付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

⑦ この信託約款において取引所とは金融商品取引法第２条第17項に規定する取引所金融商品市場および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

**【受益権の譲渡にかかる記載または記録】**

第14条　受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記

載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設した者でない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③ 委託者は、第１項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

**【受益権の譲渡の対抗要件】**

第15条　受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

**【投資の対象とする資産の種類】**

第16条　この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

２．特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

イ．為替手形

**【運用の指図範囲等】**

第17条　委託者は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

２．外国または外国の者の発行する証券で、前号の性質を有するもの

３．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

なお、第３号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

１．預金

２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

③ 第１項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

**【利害関係人等との取引等】**

第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第23条第１項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第

16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の４第３項および同条第４項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④ 前３項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第３項および同法第32条第３項の通知は行いません。

**【運用の基本方針】**

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

**【公社債の借入れの指図】**

第20条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

② 前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④ 第１項の借入れにかかる品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

**【特別の場合の外貨建有価証券への投資制限】**

第21条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

**【外国為替予約取引の指図】**

第22条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（別に定める投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

② 前項において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する別に定める投資信託証券の時価総額に別に定める投資信託証券の信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

**【信託業務の委託等】**

第23条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第１項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合する者（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

１．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２．委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

３．委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること

４．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前２項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める

者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

１．信託財産の保存にかかる業務

２．信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

３．委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務

４．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

**【混蔵寄託】**

第24条　金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第２条第９項に規定するものをいいます。本条においては、外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者を含みます。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

**【信託財産の登記等および記載等の留保等】**

第25条　信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②　前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③　信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④　動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

**【一部解約の請求および有価証券の売却等の指図】**

第26条　委託者は、信託財産に属する投資信託証券にかかる信託契約の一部解約の実行請求ならびに有価証券の売却等の指図ができます。

**【再投資の指図】**

第27条　委託者は、前条の規定による一部解約の代金、有価証券の売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

**【資金の借入れ】**

第28条　委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

１．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内

２．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

３．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10％以内

③　収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

④　借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

**【損益の帰属】**

第29条　委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

**【受託者による資金の立替え】**

第30条　信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②　信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。

③　前２項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

**【信託の計算期間】**

第31条　この信託の計算期間は、毎年９月16日から翌年９月15日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は平成29年９月14日から平成30年９月18日までとします。

②　前項の規定にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第５条に規定する信託期間の終了日とします。

**【信託財産に関する報告等】**

第32条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②　受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③　受託者は、前２項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第３項に定める報告は行わないこととします。

④　受益者は、受託者に対し、信託法第37条第２項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第１項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

**【信託事務等の諸費用】**

第33条　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部（消費税等相当額を含みます。）および受託者の立て替えた立替金の利息等（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②　前項の信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部については、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、固定率または固定金額にて計算した額を、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁するものとします。

**【信託報酬等の額】**

第34条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の88の率を乗じて得た額とします。

②　前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③　第１項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

**【収益の処理方法】**

第35条　信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

１．配当金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

２．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②　毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

**【収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責】**

第36条　受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第37条第３項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第37条第４項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

**【収益分配金、償還金および一部解約金の支払いならびに収益分配金の再投資】**

第37条　収益分配金は、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める「累積投資約款」に従った契約（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、その場合は、当該別の名称に読み替えるものとします。）に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第３項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

④ 一部解約金は、第39条第１項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として６営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第２項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。なお、「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。また、「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。

**【収益分配金および償還金の時効】**

第38条　受益者が、収益分配金については前条第１項に規定する支払開始日から５年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第３項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

**【信託契約の一部解約】**

第39条　受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に１口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、一部解約の実行の請求日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、当該一部解約の実行の請求を受け付けません。

③ 委託者は、第１項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第１項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機

関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。

⑤ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

⑥ 委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第１項による一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。

⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止前に行った実行されていない一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第４項の規定に準じて算出した価額とします。

**【質権口記載または記録の受益権の取扱い】**

第40条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

**【信託契約の解約】**

第41条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④ 第２項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

⑤ 第２項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第２項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

**【信託契約に関する監督官庁の命令】**

第42条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第46条の規定に従います。

**【委託者の登録取消等に伴う取扱い】**

第43条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第46条第２項の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

**【委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い】**

第44条　委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②　委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

**【受託者の辞任および解任に伴う取扱い】**

第45条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第46条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②　委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

**【信託約款の変更等】**

第46条　委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②　委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③　前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④　第２項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

⑤　書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥　第２項から前項までの規定は、委託者が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑦　前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

**【反対受益者の受益権買取請求の不適用】**

第47条　この信託は、受益者が第39条の規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託者が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第41条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第１項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

**【他の受益者の氏名等の開示の請求の制限】**

第48条　この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

**【信託期間の延長】**

第49条　＜削除＞

**【運用状況に係る情報の提供】**

第50条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第１項に定める事項に係る情報を電磁的方法により提供します。

②　前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から前項に定める情報の提供について、書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行うものとします。

**【公告】**

第51条　委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。
https://www.smd-am.co.jp

②　前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は日本経済新聞に掲載します。

**【信託約款に関する疑義の取扱い】**

第52条　この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成29年９月14日（信託契約締結日）

委託者　　東京都港区愛宕二丁目５番１号
三井住友アセットマネジメント株式会社
代表取締役　　松下　隆史

受託者　　東京都千代田区丸の内一丁目４番１号
三井住友信託銀行株式会社
取締役社長　　橋本　勝

## 〔付表〕

１．運用の基本方針および信託約款第17条第１項に規定する「別に定める投資信託証券」は下記のものとします。

親投資信託　国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）
親投資信託　外国株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　エマージング株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　Ｊリート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　外国リート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　国内債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　外国債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
米国籍米ドル建て投資信託　ｉシェアーズ　Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ

２．信託約款第13条第５項および第39条第２項に規定する「別に定める日」は下記のものとします。

・ニューヨークの取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日

# 追加型証券投資信託
# 三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）
# 約款

三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社

## 〔運用の基本方針〕

信託約款第19条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は以下の通りとします。

１．基本方針

この投資信託は、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

別に定める投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主として別に定める投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。

・主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券に投資します。

・別に定める投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

② イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

・基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

③ 実質組入外貨建資産については、別に定める投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

④ 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

⑤ 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

① 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

② 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

③ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

④ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

３．収益分配方針

年１回（原則として毎年９月15日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

① 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。

② 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託者の判断により分配を行わないことがあります。

③ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

# 追加型証券投資信託
# 『三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型)』
# 〔信託約款〕

**【信託の種類、委託者および受託者】**

第１条　この信託は、証券投資信託であり、三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

②　この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

**【信託事務の委託】**

第２条　受託者は、信託法第28条第１号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第１条第１項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第２条第１項にて準用する信託業法第29条第２項第１号に規定する利害関係人をいいます。以下この条、第18条第１項および第２項、第23条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②　前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

**【信託の目的および金額】**

第３条　委託者は、金2,000,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

**【信託金の限度額】**

第４条　委託者は、受託者と合意の上、金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②　委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

**【信託期間】**

第５条　この信託の期間は、信託契約締結日から第41条第１項、第42条第１項、第43条第１項、第45条第２項による信託終了の日までとします。

**【受益権の取得申込みの勧誘の種類】**

第６条　この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第２条第３項第１号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第８項で定める公募により行われます。

**【当初の受益者】**

第７条　この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第８条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

**【受益権の分割および再分割】**

第８条　委託者は、第３条の規定による受益権については2,000,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第９条第１項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②　委託者は、受託者と協議の上、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

**【追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法】**

第９条　追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②　この信託約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（第20条に規定する借入れ公社債を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

③　第22条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

**【信託日時の異なる受益権の内容】**

第10条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

**【受益権の帰属と受益証券の不発行】**

第11条　この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第２条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③ 委託者は、第８条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

**【受益権の設定にかかる受託者の通知】**

第12条　受託者は、第３条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

**【受益権の申込単位および価額】**

第13条　指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第１項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第２条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第８条第１項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、当該指定販売会社がそれぞれ別に定める単位をもって取得申込みに応じることができるものとします。

② 前項の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第３項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

③ 第１項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みにかかる受益権の価額は、１口につき１円に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。

④ 前項の規定にかかわらず、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第31条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑤ 前各項の規定にかかわらず、指定販売会社は、この信託契約締結日以降において、取得申込日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、当該取得申込みに応じません。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付けを中止することおよび既に受け付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

⑦ この信託約款において取引所とは金融商品取引法第２条第17項に規定する取引所金融商品市場および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

**【受益権の譲渡にかかる記載または記録】**

第14条　受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記

載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設した者でない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③ 委託者は、第１項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

**【受益権の譲渡の対抗要件】**

第15条　受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

**【投資の対象とする資産の種類】**

第16条　この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

２．特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

イ．為替手形

**【運用の指図範囲等】**

第17条　委託者は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

２．外国または外国の者の発行する証券で、前号の性質を有するもの

３．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

なお、第３号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

１．預金

２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

③ 第１項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

**【利害関係人等との取引等】**

第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第23条第１項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第

16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の４第３項および同条第４項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④ 前３項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第３項および同法第32条第３項の通知は行いません。

**【運用の基本方針】**

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

**【公社債の借入れの指図】**

第20条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

② 前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④ 第１項の借入れにかかる品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

**【特別の場合の外貨建有価証券への投資制限】**

第21条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

**【外国為替予約取引の指図】**

第22条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（別に定める投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

② 前項において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する別に定める投資信託証券の時価総額に別に定める投資信託証券の信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

**【信託業務の委託等】**

第23条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第１項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合する者（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

１．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２．委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

３．委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること

４．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前２項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める

者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

１．信託財産の保存にかかる業務

２．信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

３．委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務

４．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

**【混蔵寄託】**

第24条　金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第２条第９項に規定するものをいいます。本条においては、外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者を含みます。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

**【信託財産の登記等および記載等の留保等】**

第25条　信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②　前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③　信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④　動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

**【一部解約の請求および有価証券の売却等の指図】**

第26条　委託者は、信託財産に属する投資信託証券にかかる信託契約の一部解約の実行請求ならびに有価証券の売却等の指図ができます。

**【再投資の指図】**

第27条　委託者は、前条の規定による一部解約の代金、有価証券の売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

**【資金の借入れ】**

第28条　委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

１．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内

２．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

３．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10％以内

③　収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

④　借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

**【損益の帰属】**

第29条　委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

**【受託者による資金の立替え】**

第30条　信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②　信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。

③　前２項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

**【信託の計算期間】**

第31条　この信託の計算期間は、毎年９月16日から翌年９月15日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は平成29年９月14日から平成30年９月18日までとします。

②　前項の規定にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第５条に規定する信託期間の終了日とします。

**【信託財産に関する報告等】**

第32条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②　受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③　受託者は、前２項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第３項に定める報告は行わないこととします。

④　受益者は、受託者に対し、信託法第37条第２項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第１項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

**【信託事務等の諸費用】**

第33条　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部（消費税等相当額を含みます。）および受託者の立て替えた立替金の利息等（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②　前項の信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部については、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、固定率または固定金額にて計算した額を、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁するものとします。

**【信託報酬等の額】**

第34条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の88の率を乗じて得た額とします。

②　前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③　第１項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

**【収益の処理方法】**

第35条　信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

１．配当金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

２．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②　毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

**【収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責】**

第36条　受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第37条第３項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第37条第４項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

**【収益分配金、償還金および一部解約金の支払いならびに収益分配金の再投資】**

第37条　収益分配金は、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める「累積投資約款」に従った契約（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、その場合は、当該別の名称に読み替えるものとします。）に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第３項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

④ 一部解約金は、第39条第１項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として６営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第２項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。なお、「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。また、「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。

**【収益分配金および償還金の時効】**

第38条　受益者が、収益分配金については前条第１項に規定する支払開始日から５年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第３項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

**【信託契約の一部解約】**

第39条　受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に１口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、一部解約の実行の請求日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、当該一部解約の実行の請求を受け付けません。

③ 委託者は、第１項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第１項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機

関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。

⑤ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

⑥ 委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第１項による一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。

⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止前に行った実行されていない一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第４項の規定に準じて算出した価額とします。

**【質権口記載または記録の受益権の取扱い】**

第40条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

**【信託契約の解約】**

第41条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④ 第２項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

⑤ 第２項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第２項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

**【信託契約に関する監督官庁の命令】**

第42条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第46条の規定に従います。

**【委託者の登録取消等に伴う取扱い】**

第43条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第46条第２項の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

**【委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い】**

第44条　委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②　委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

**【受託者の辞任および解任に伴う取扱い】**

第45条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第46条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②　委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

**【信託約款の変更等】**

第46条　委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②　委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③　前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④　第２項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

⑤　書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥　第２項から前項までの規定は、委託者が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑦　前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

**【反対受益者の受益権買取請求の不適用】**

第47条　この信託は、受益者が第39条の規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託者が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第41条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第１項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

**【他の受益者の氏名等の開示の請求の制限】**

第48条　この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

**【信託期間の延長】**

第49条　＜削除＞

**【運用状況に係る情報の提供】**

第50条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第１項に定める事項に係る情報を電磁的方法により提供します。

②　前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から前項に定める情報の提供について、書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行うものとします。

**【公告】**

第51条　委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。
https://www.smd-am.co.jp

②　前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は日本経済新聞に掲載します。

**【信託約款に関する疑義の取扱い】**

第52条　この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成29年９月14日（信託契約締結日）

委託者　　東京都港区愛宕二丁目５番１号
三井住友アセットマネジメント株式会社
代表取締役　　松下　隆史

受託者　　東京都千代田区丸の内一丁目４番１号
三井住友信託銀行株式会社
取締役社長　　橋本　勝

## 〔付表〕

１．運用の基本方針および信託約款第17条第１項に規定する「別に定める投資信託証券」は下記のものとします。

親投資信託　国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）
親投資信託　外国株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　エマージング株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　Ｊリート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　外国リート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　国内債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　外国債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
米国籍米ドル建て投資信託　ｉシェアーズ　Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ

２．信託約款第13条第５項および第39条第２項に規定する「別に定める日」は下記のものとします。

・ニューヨークの取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日

# 追加型証券投資信託
# 三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）
# 約款

三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社

## 〔運用の基本方針〕

信託約款第19条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は以下の通りとします。

１．基本方針

この投資信託は、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

２．運用方法

(1) 投資対象

別に定める投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主として別に定める投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資することにより、長期的な視点の基に信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

・主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券に投資します。

・別に定める投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

② イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

・基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

③ 実質組入外貨建資産については、別に定める投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

④ 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

⑤ 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

① 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

② 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

③ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

④ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

３．収益分配方針

年１回（原則として毎年９月15日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

① 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。

② 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託者の判断により分配を行わないことがあります。

③ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

# 追加型証券投資信託
# 『三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）』
# 〔信託約款〕

**【信託の種類、委託者および受託者】**

第１条　この信託は、証券投資信託であり、三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

②　この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

**【信託事務の委託】**

第２条　受託者は、信託法第28条第１号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第１条第１項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第２条第１項にて準用する信託業法第29条第２項第１号に規定する利害関係人をいいます。以下この条、第18条第１項および第２項、第23条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②　前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

**【信託の目的および金額】**

第３条　委託者は、金2,000,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

**【信託金の限度額】**

第４条　委託者は、受託者と合意の上、金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②　委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

**【信託期間】**

第５条　この信託の期間は、信託契約締結日から第41条第１項、第42条第１項、第43条第１項、第45条第２項による信託終了の日までとします。

**【受益権の取得申込みの勧誘の種類】**

第６条　この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第２条第３項第１号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第８項で定める公募により行われます。

**【当初の受益者】**

第７条　この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第８条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

**【受益権の分割および再分割】**

第８条　委託者は、第３条の規定による受益権については2,000,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第９条第１項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②　委託者は、受託者と協議の上、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

**【追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法】**

第９条　追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

②　この信託約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（第20条に規定する借入れ公社債を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

③　第22条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

**【信託日時の異なる受益権の内容】**

第10条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

**【受益権の帰属と受益証券の不発行】**

第11条　この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第２条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③ 委託者は、第８条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

**【受益権の設定にかかる受託者の通知】**

第12条　受託者は、第３条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

**【受益権の申込単位および価額】**

第13条　指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第１項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第２条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第８条第１項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、当該指定販売会社がそれぞれ別に定める単位をもって取得申込みに応じることができるものとします。

② 前項の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第３項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

③ 第１項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みにかかる受益権の価額は、１口につき１円に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。

④ 前項の規定にかかわらず、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第31条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑤ 前各項の規定にかかわらず、指定販売会社は、この信託契約締結日以降において、取得申込日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、受益者が第37条第２項に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、当該取得申込みに応じません。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付けを中止することおよび既に受け付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

⑦ この信託約款において取引所とは金融商品取引法第２条第17項に規定する取引所金融商品市場および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

**【受益権の譲渡にかかる記載または記録】**

第14条　受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記

載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設した者でない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③ 委託者は、第１項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

**【受益権の譲渡の対抗要件】**

第15条　受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

**【投資の対象とする資産の種類】**

第16条　この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

２．特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

イ．為替手形

**【運用の指図範囲等】**

第17条　委託者は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

２．外国または外国の者の発行する証券で、前号の性質を有するもの

３．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

なお、第３号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

１．預金

２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

③ 第１項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

**【利害関係人等との取引等】**

第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第23条第１項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第

16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の４第３項および同条第４項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条、第17条第１項および第２項に定める資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④ 前３項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第３項および同法第32条第３項の通知は行いません。

**【運用の基本方針】**

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

**【公社債の借入れの指図】**

第20条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図をするものとします。

② 前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④ 第１項の借入れにかかる品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

**【特別の場合の外貨建有価証券への投資制限】**

第21条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

**【外国為替予約取引の指図】**

第22条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（別に定める投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

② 前項において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する別に定める投資信託証券の時価総額に別に定める投資信託証券の信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

**【信託業務の委託等】**

第23条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第１項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合する者（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

１．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２．委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

３．委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること

４．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前２項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める

者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

１．信託財産の保存にかかる業務

２．信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

３．委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務

４．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

**【混蔵寄託】**

第24条　金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第２条第９項に規定するものをいいます。本条においては、外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者を含みます。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

**【信託財産の登記等および記載等の留保等】**

第25条　信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②　前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③　信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④　動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

**【一部解約の請求および有価証券の売却等の指図】**

第26条　委託者は、信託財産に属する投資信託証券にかかる信託契約の一部解約の実行請求ならびに有価証券の売却等の指図ができます。

**【再投資の指図】**

第27条　委託者は、前条の規定による一部解約の代金、有価証券の売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

**【資金の借入れ】**

第28条　委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②　一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

１．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内

２．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

３．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10％以内

③　収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

④　借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

**【損益の帰属】**

第29条　委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

**【受託者による資金の立替え】**

第30条　信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②　信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。

③　前２項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

**【信託の計算期間】**

第31条　この信託の計算期間は、毎年９月16日から翌年９月15日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は平成29年９月14日から平成30年９月18日までとします。

②　前項の規定にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第５条に規定する信託期間の終了日とします。

**【信託財産に関する報告等】**

第32条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②　受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③　受託者は、前２項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第３項に定める報告は行わないこととします。

④　受益者は、受託者に対し、信託法第37条第２項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第１項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

**【信託事務等の諸費用】**

第33条　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部（消費税等相当額を含みます。）および受託者の立て替えた立替金の利息等（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②　前項の信託財産の財務諸表の監査費用の全部または一部については、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、固定率または固定金額にて計算した額を、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁するものとします。

**【信託報酬等の額】**

第34条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の88の率を乗じて得た額とします。

②　前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③　第１項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

**【収益の処理方法】**

第35条　信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

１．配当金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

２．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②　毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

**【収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責】**

第36条　受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第37条第３項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第37条第４項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

**【収益分配金、償還金および一部解約金の支払いならびに収益分配金の再投資】**

第37条　収益分配金は、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める「累積投資約款」に従った契約（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、その場合は、当該別の名称に読み替えるものとします。）に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第３項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

④ 一部解約金は、第39条第１項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として６営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第２項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。なお、「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。また、「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど、当該口数により加重平均され、収益分配のつど、調整されるものとします。

**【収益分配金および償還金の時効】**

第38条　受益者が、収益分配金については前条第１項に規定する支払開始日から５年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第３項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

**【信託契約の一部解約】**

第39条　受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に１口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、一部解約の実行の請求日が別に定める日のいずれかに当たる場合には、当該一部解約の実行の請求を受け付けません。

③ 委託者は、第１項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第１項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機

関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。

⑤ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

⑥ 委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第１項による一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。

⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止前に行った実行されていない一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第４項の規定に準じて算出した価額とします。

**【質権口記載または記録の受益権の取扱い】**

第40条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

**【信託契約の解約】**

第41条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④ 第２項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

⑤ 第２項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第２項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

**【信託契約に関する監督官庁の命令】**

第42条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第46条の規定に従います。

**【委託者の登録取消等に伴う取扱い】**

第43条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第46条第２項の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

**【委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い】**

第44条　委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②　委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

**【受託者の辞任および解任に伴う取扱い】**

第45条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第46条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②　委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

**【信託約款の変更等】**

第46条　委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②　委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③　前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④　第２項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

⑤　書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥　第２項から前項までの規定は、委託者が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑦　前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

**【反対受益者の受益権買取請求の不適用】**

第47条　この信託は、受益者が第39条の規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託者が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第41条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第１項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

**【他の受益者の氏名等の開示の請求の制限】**

第48条　この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

**【信託期間の延長】**

第49条　＜削除＞

**【運用状況に係る情報の提供】**

第50条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第１項に定める事項に係る情報を電磁的方法により提供します。

②　前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から前項に定める情報の提供について、書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行うものとします。

**【公告】**

第51条　委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。
https://www.smd-am.co.jp

②　前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は日本経済新聞に掲載します。

**【信託約款に関する疑義の取扱い】**

第52条　この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成29年９月14日（信託契約締結日）

委託者　　東京都港区愛宕二丁目５番１号
三井住友アセットマネジメント株式会社
代表取締役　　松下　隆史

受託者　　東京都千代田区丸の内一丁目４番１号
三井住友信託銀行株式会社
取締役社長　　橋本　勝

## 〔付表〕

１．運用の基本方針および信託約款第17条第１項に規定する「別に定める投資信託証券」は下記のものとします。

親投資信託　国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）
親投資信託　外国株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　エマージング株式インデックス・マザーファンド
親投資信託　Ｊリート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　外国リート・インデックス・マザーファンド
親投資信託　国内債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　外国債券パッシブ・マザーファンド
親投資信託　ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
米国籍米ドル建て投資信託　ｉシェアーズ　Ｊ．Ｐ．モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ＥＴＦ

２．信託約款第13条第５項および第39条第２項に規定する「別に定める日」は下記のものとします。

・ニューヨークの取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日